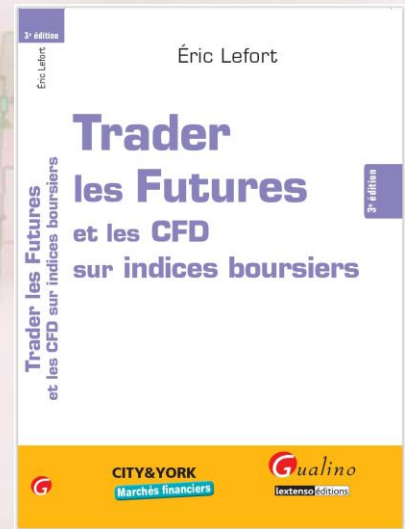


Le SuperTrend

Présenté par Eric Lefort

En collaboration avec WHSelfinvest



- Comprendre la construction du SuperTrend
- Le SuperTrend en tant que signal
- Le SuperTrend en tant que filtre
- Le SuperTrend en tant que stop
- Efficacité du filtre
- Pertinence du signal
- Avantages et défauts du stop
- Combinaison classique signal et filtre
- Efficacité du signal
- Etude sur plusieurs unités de temps liées
- Nouvelle programmation du SuperTrend
- Systèmes plus simples
- Conclusion

La construction du SuperTrend

- Auteur : Créé par le trader français **Olivier Seban**, le Supertrend est un indicateur technique qui vise à détecter les tendances des cours. C'est un outil assez utilisé par les analystes et notamment en ce qui concerne son utilité pour fixer des stops de protection et pour détecter la tendance.
- L'auteur s'est très fortement inspiré des bandes de Keltner, outil élaboré en 1960.

La construction du SuperTrend

- Calcul : La première étape consiste à calculer l'ATR ("Average true Range") qui est une mesure de la volatilité) sur une période d'historique définie puis ensuite les deux bandes de l'indicateur :
- **Tendance haussière** = $(\text{plus haut} + \text{plus bas}) / 2 + \text{coef} * \text{ATR}(n)$
Tendance baissière = $(\text{plus haut} + \text{plus bas}) / 2 - \text{coef} * \text{ATR}(n)$
- Avec :
- **n** : période de calcul de l'ATR, typiquement 10
coef : coefficient permettant de pondérer la volatilité mesurée par l'ATR. La formule standard utilise un coefficient de 3

Représentation du Supertrend

Sur la représentation graphique on n'affiche que la tendance haussière ou que la tendance baissière qui alternent en vertu de la règle suivante : la tendance passe à la hausse quand le cours de clôture dépasse la valeur précédente de la tendance baissière. Inversement, quand le cours de clôture passe sous le niveau de la tendance haussière, elle devient baissière.

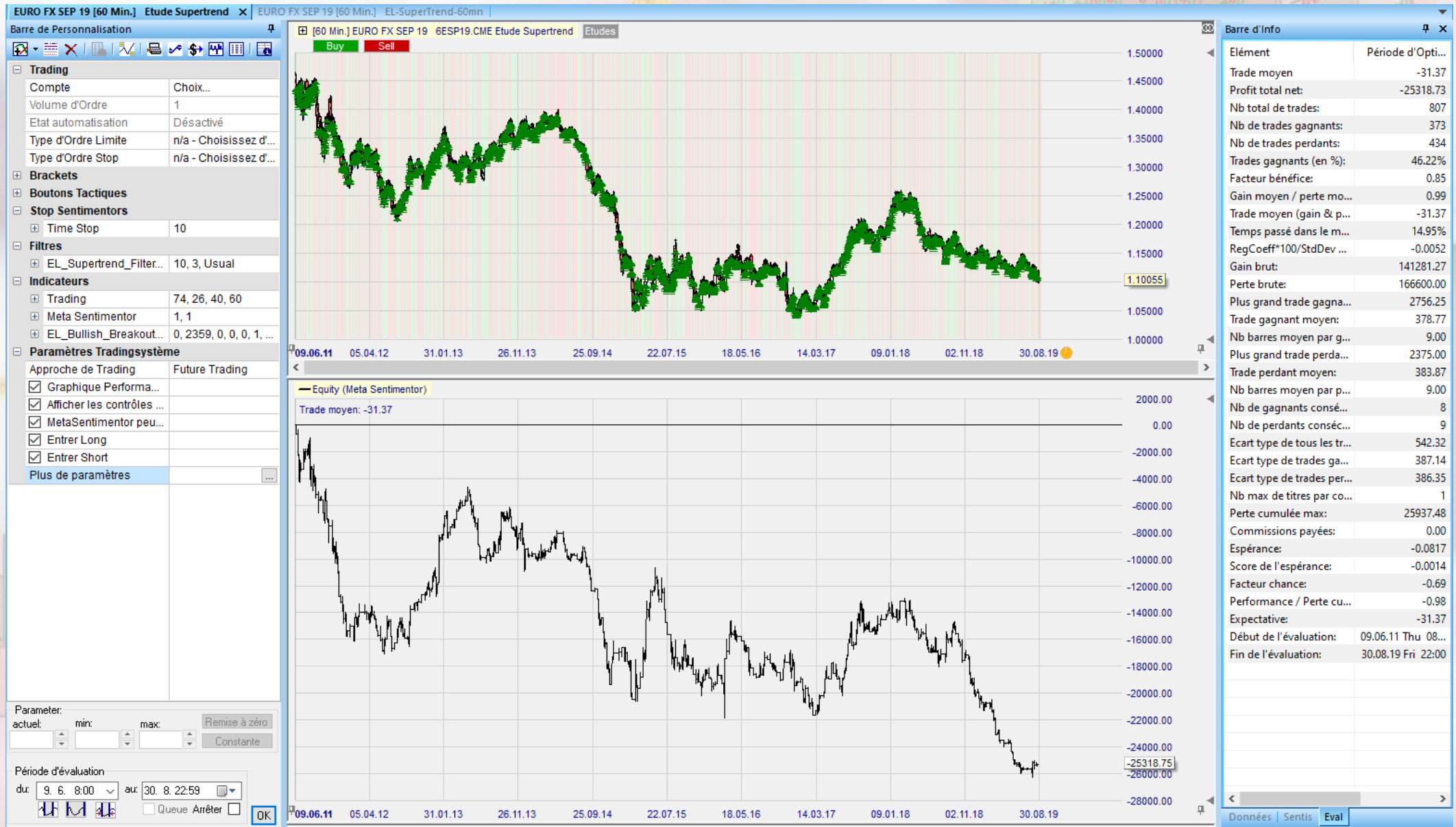


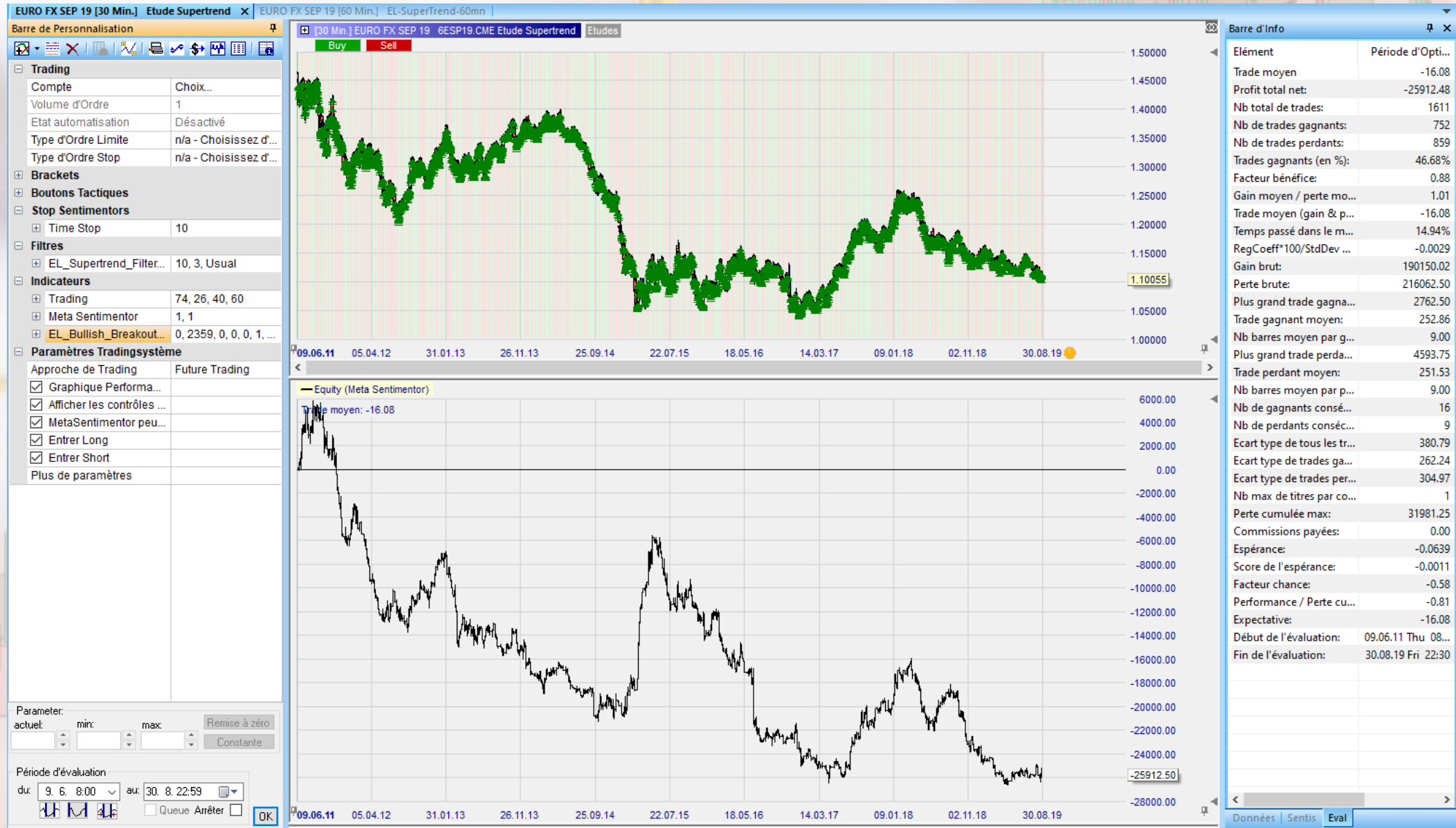
Le SuperTrend en tant que filtre de tendance

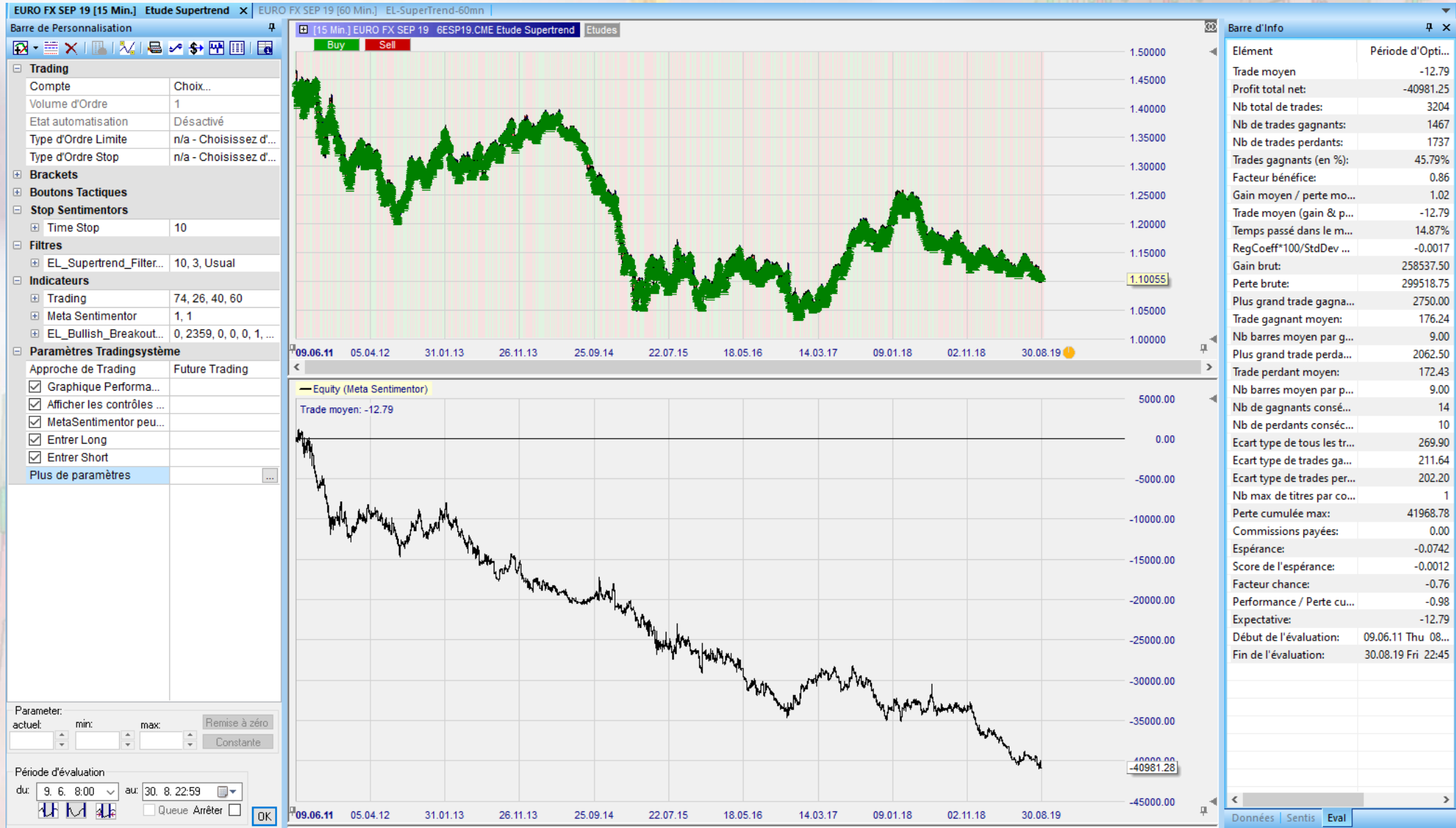
Pour tester, on utilise :

- la **cassure haussière** qui est un signal d'entrée avec lequel il est plutôt facile de monter un système gagnant ... à condition de bien filtrer le tendance. De plus, les signaux sont plus nombreux en trend haussier qu'en trend baissier ce qui facilite la rentabilité quand le filtre est bon.
- Le **TimeStop** en signal de sortie.
- Le **SuperTrend** en tant que filtre.



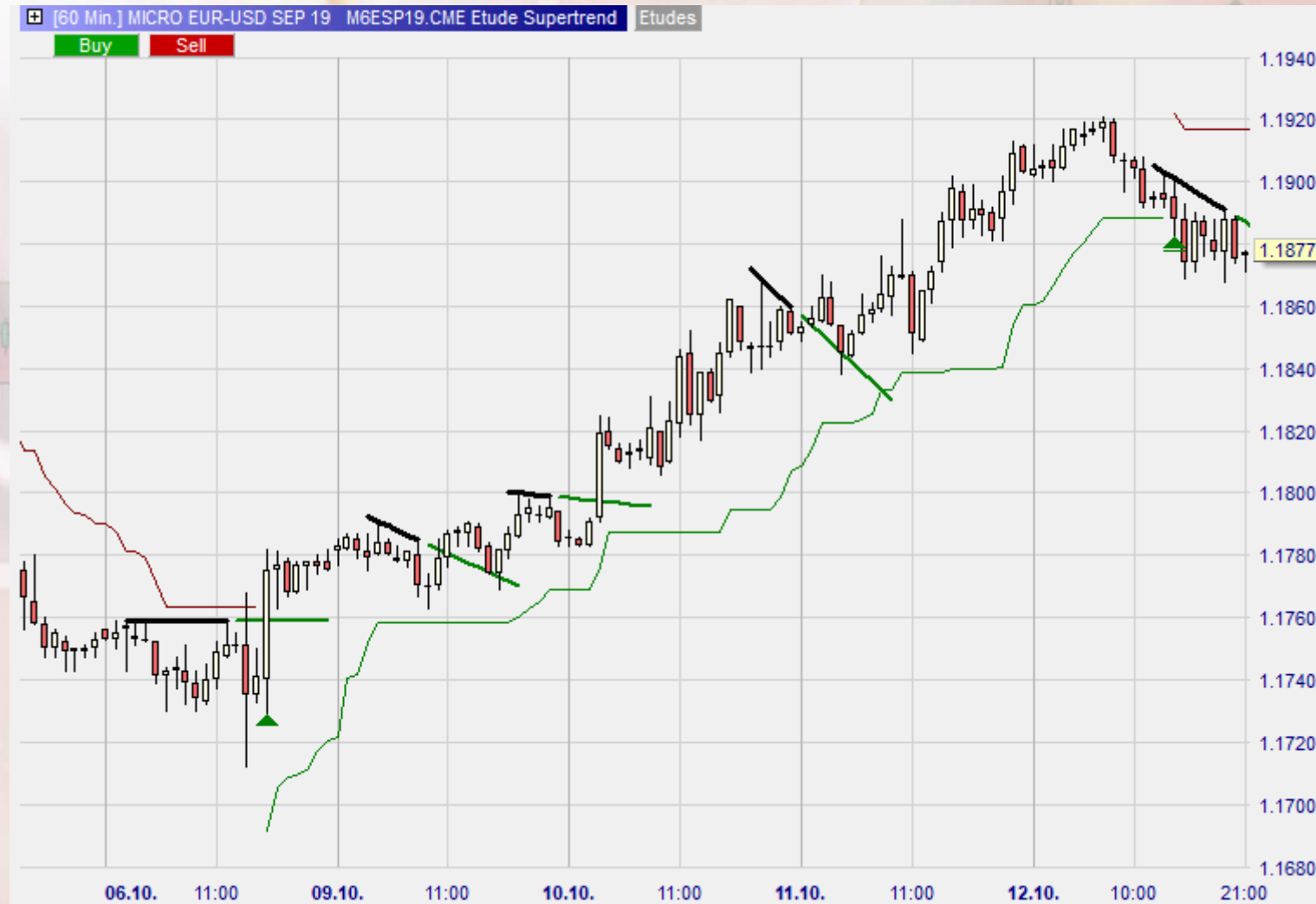








Le SuperTrend en tant que stop suiveur



Le SuperTrend en stop suiveur : problème

- Il est nécessaire que le SuperTrend soit déjà dans le sens du signal pour qu'il puisse être opérationnel.
- Si par exemple on a un signal d'achat et que le ST est baissier, alors il faut attendre qu'il soit haussier pour qu'il puisse jouer son rôle de stop.

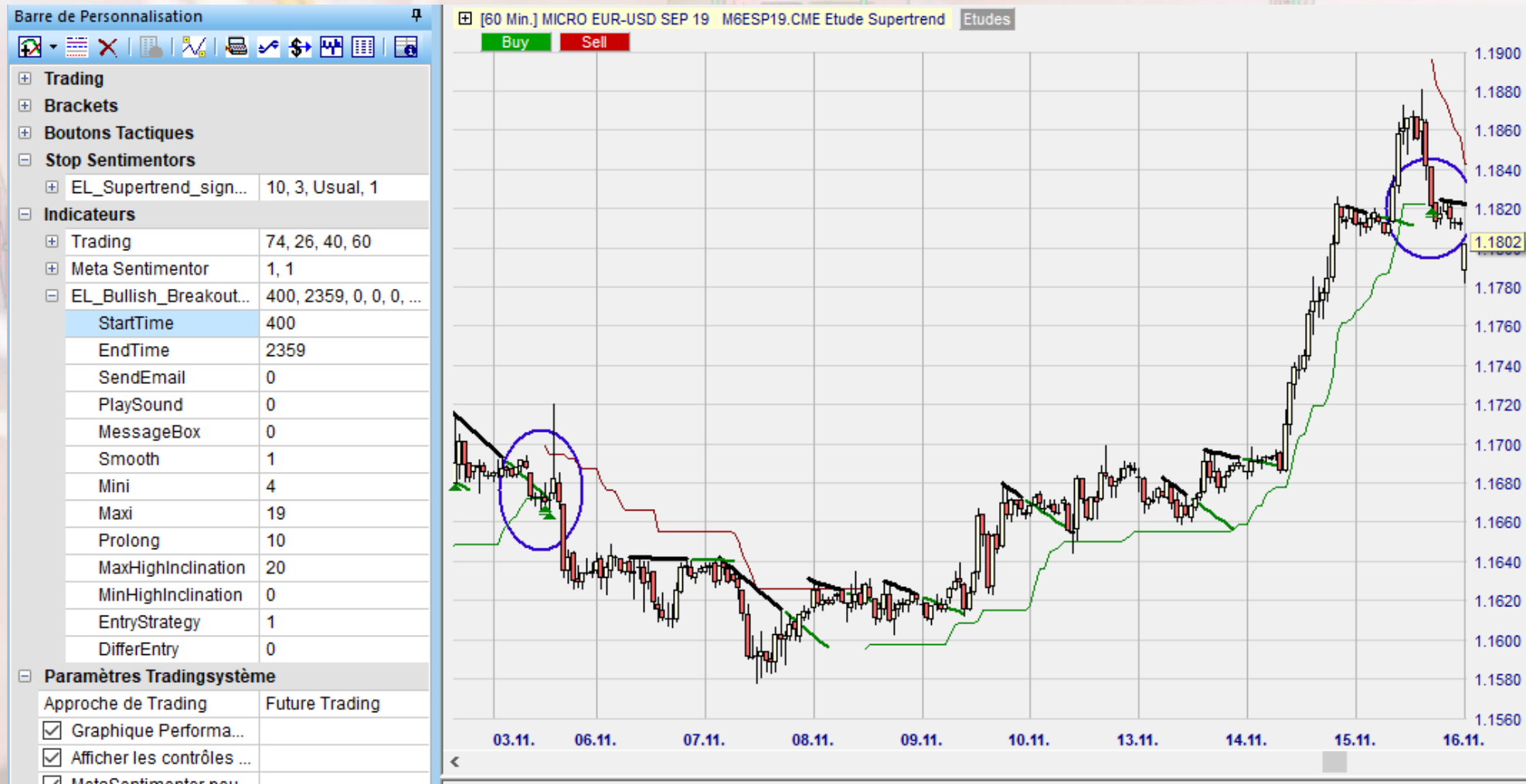


Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Pour pouvoir utiliser des signaux avec le SuperTrend en stop suiveur il faut donc également utiliser le MEME SuperTrend en tant que filtre.

Sans filtre



- Pour pouvoir utiliser des signaux avec le SuperTrend en stop suiveur il faut donc également utiliser le MEME SuperTrend en tant que filtre.

Avec filtre



Le SuperTrend en tant que stop suiveur

Cette contrainte de filtrage conduira malheureusement à rater les meilleurs départs, c'est-à-dire à minorer les plus gros gains.



Le SuperTrend en tant que stop suiveur

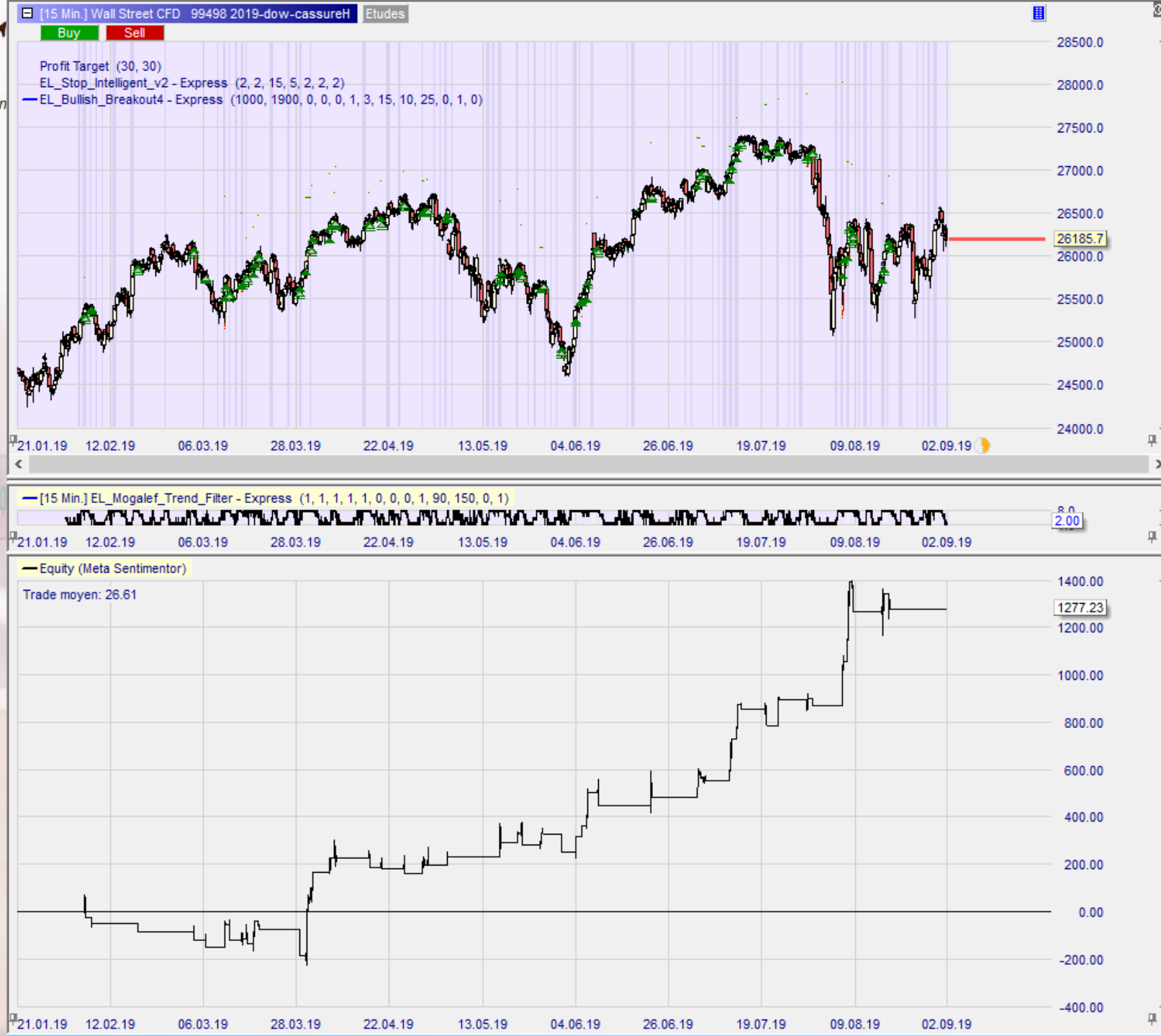
- Il est très difficile d'estimer la valeur d'un stop suiveur car son efficacité sera différente pour chaque système de trading.
- Pour faire un essai honnête j'ai choisi le système de trading Mogalef sur le CFD Dow qui tourne depuis de nombreux mois. J'y ai enlevé le stop fixe à 1,2 ATR pour le rendre un peu moins performant ainsi que le TrailingStop EOP. Ceci permettra une meilleure comparaison des stops suiveurs.

Mogalef T

"There's no certitude, on

Le trailing stop
Stop Intelligent
sera remplacé par
le trailing stop
SuperTrend.

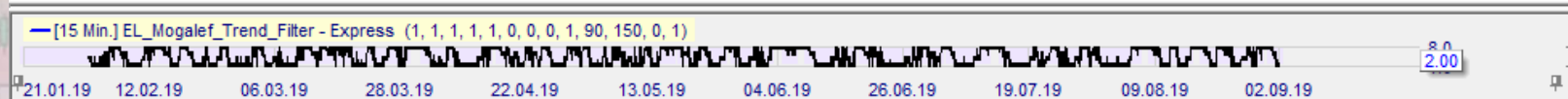
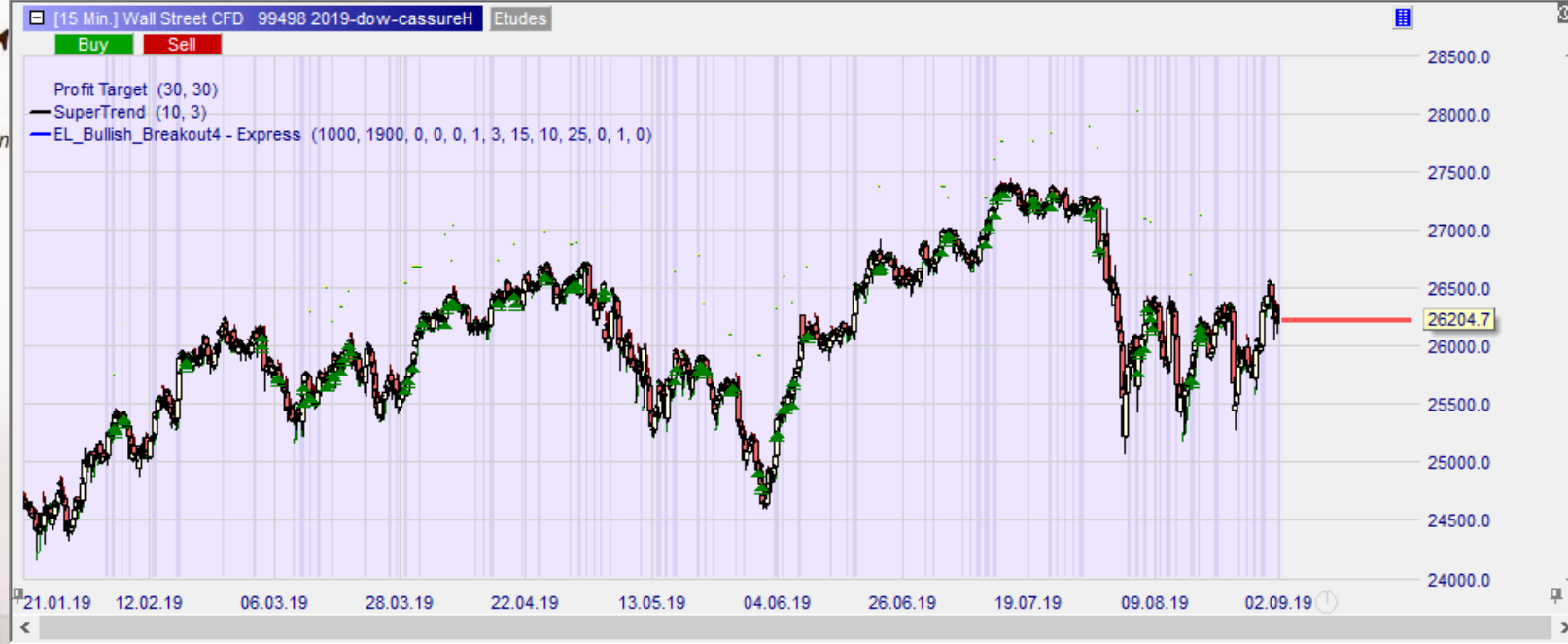
Ici les résultats
récents avec le
Stop Intelligent.



Elément	Période d'Opti...
Trade moyen	26.61
Profit total net:	1277.23
Nb total de trades:	48
Nb de trades gagnants:	24
Nb de trades perdants:	24
Trades gagnants (en %):	50.00%
Facteur bénéfice:	2.34
Gain moyen / perte mo...	2.34
Trade moyen (gain & p...	26.61
Temps passé dans le m...	6.69%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0222
Gain brut:	2231.21
Perte brute:	953.98
Plus grand trade gagna...	334.60
Trade gagnant moyen:	92.97
Nb barres moyen par g...	26.83
Plus grand trade perda...	111.40
Trade perdant moyen:	39.75
Nb barres moyen par p...	13.42
Nb de gagnants consé...	4
Nb de perdants consé...	5
Ecart type de tous les tr...	89.05
Ecart type de trades ga...	79.08
Ecart type de trades per...	27.62
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	188.79
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6694
Score de l'espérance:	0.0022
Facteur chance:	4.71
Performance / Perte cu...	6.77
Expectative:	26.61
Début de l'évaluation:	21.01.19 Mon 0...
Fin de l'évaluation:	02.09.19 Mon 1...

Mogalef T

"There's no certitude, on



Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	14.10
Profit total net:	676.90
Nb total de trades:	48
Nb de trades gagnants:	23
Nb de trades perdants:	25
Trades gagnants (en %):	47.92%
Facteur bénéfice:	1.45
Gain moyen / perte mo...	1.58
Trade moyen (gain & p...	14.10
Temps passé dans le m...	7.51%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0218
Gain brut:	2174.50
Perte brute:	1497.60
Plus grand trade gagna...	401.00
Trade gagnant moyen:	94.54
Nb barres moyen par g...	28.52
Plus grand trade perda...	411.00
Trade perdant moyen:	59.90
Nb barres moyen par p...	17.16
Nb de gagnants consé...	5
Nb de perdants consé...	5
Ecart type de tous les tr...	120.01
Ecart type de trades ga...	102.39
Ecart type de trades per...	81.77
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	411.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.2354
Score de l'espérance:	0.0008
Facteur chance:	0.80
Performance / Perte cu...	1.65
Expectative:	14.10
Début de l'évaluation:	21.01.19 Mon 0...
Fin de l'évaluation:	02.09.19 Mon 1...

Données | Sentis | Eval

Ici le résultat avec le Stop SuperTrend. Moins bon.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

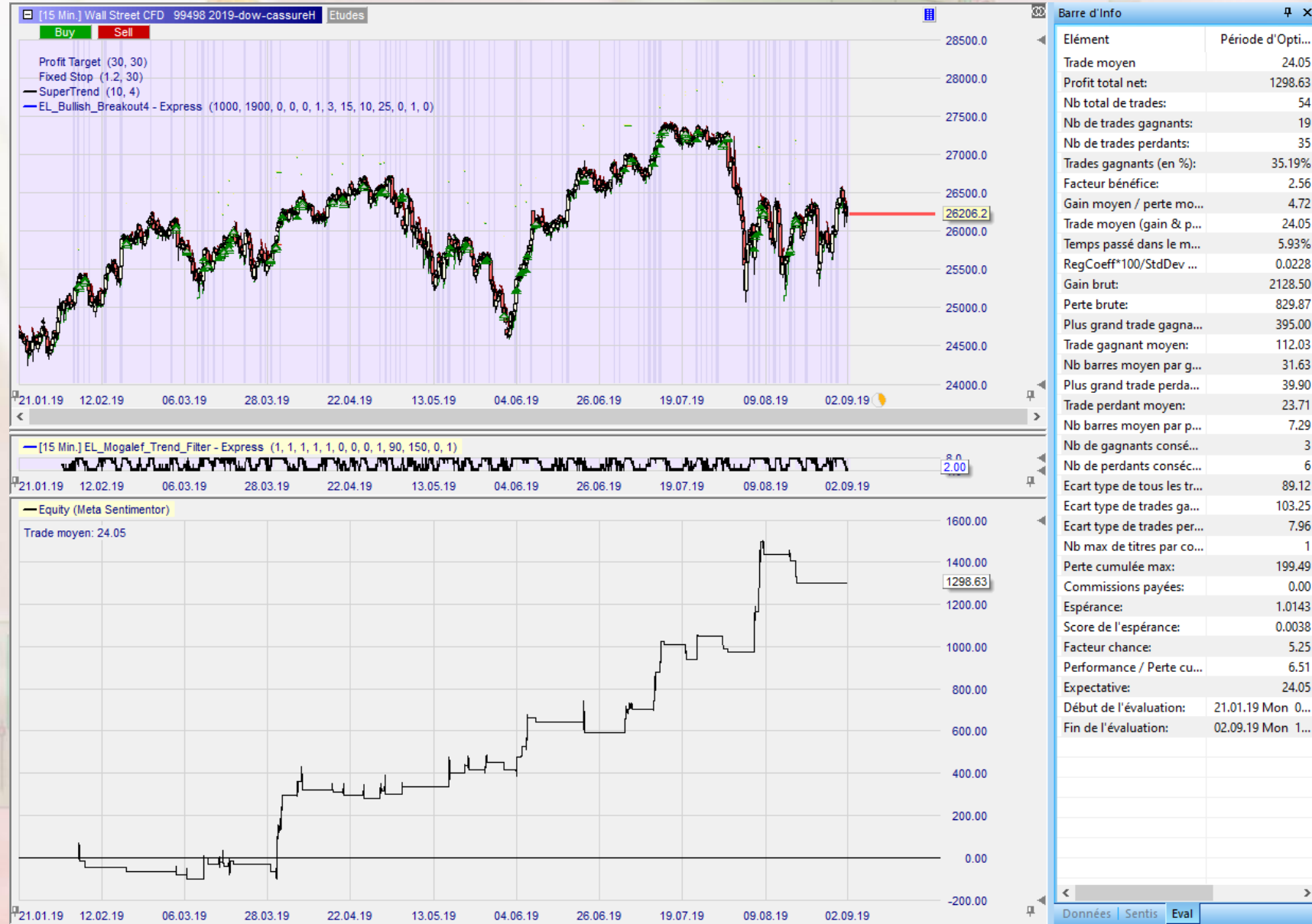
- Cependant, en réglant le SuperTrend sur un facteur ATR de 4 au lieu de 3 on obtient un résultat acceptable, sauf en ce qui concerne les fortes pertes (défaut du stop SuperTrend).



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- On corrige ce défaut en ajoutant un stop fixe.
- Mais attention : la bonne performance n'est possible que grâce à la bonne base du système.
- Ce test montre cependant que l'utilisation du stop SuperTrend peut assez facilement apporter à un système de trading.



Le SuperTrend en tant que signal

Pour tester on utilise :

- Le SuperTrend en signal d'entrée. (court et long)
- Le TimeStop en signal de sortie.



Signal sur 60mn



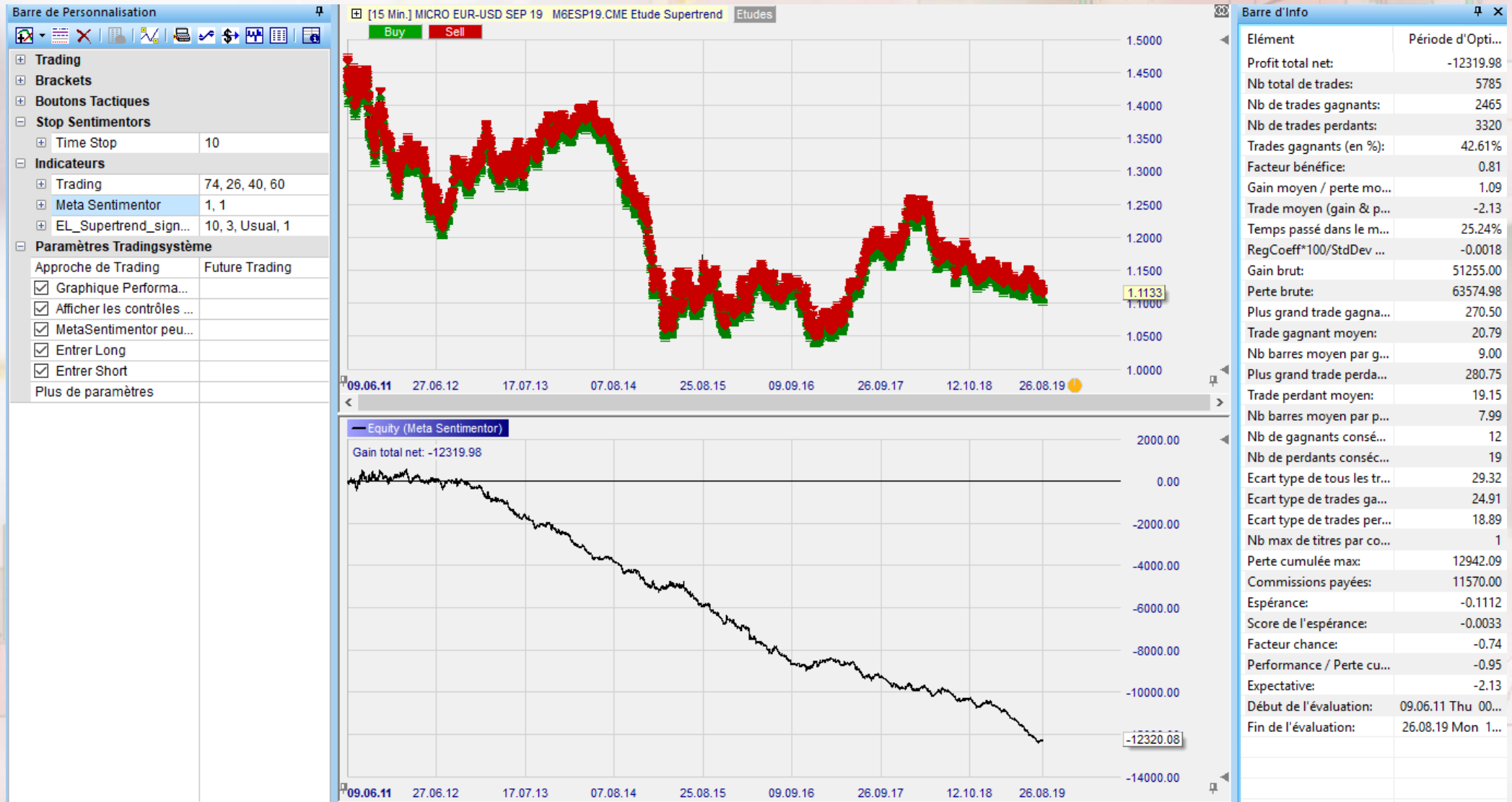
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" ∨

Signal sur 30mn



Signal sur 15mn



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" ∨

Signal sur 5mn



Quand le signal est-il profitable, quand génère-t-il une perte?



Quand le signal est-il profitable, quand génère-t-il une perte?



Quand le signal est-il profitable, quand génère-t-il une perte?



Quand le signal est-il profitable, quand génère-t-il une perte?



Quand le signal est-il profitable, quand génère-t-il une perte?

- Un range provoque une succession de pertes.
- Un tendance brève ou une simple augmentation de volatilité sans direction provoque souvent une perte.
- Un tendance durable permet un gain parfois important, parfois modéré.

Attention : toute tendance commence par un range :



Il est pratiquement impossible de discerner un début de tendance d'une continuation de range.

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Le problème du signal Supertrend est qu'il

- Interviendra un peu trop tard pour prendre une tendance au début
- Interviendra trop tôt pour ne pas confondre avec un range perdant.





Pause ?

- On sait donc qu'en range un système basé sur le signal supertrend sera largement perdant (on achète au plus haut pour revendre au plus bas).
- Sur une UT inférieure le signal interviendra plus tôt mais sera toujours aussi mauvais. Par ailleurs il y aura plus de signaux sur une UT inférieure. (Alternances plus nombreuses entre signaux d'achat et de vente)
- D'où l'idée de suivre les signaux de l'UT supérieure **uniquement** à partir du moment où ils sont **contredits** sur l'UT inférieure.
- Le suivi de tendance (si tendance il y a) devra être assuré sur l'UT supérieure de manière à profiter au maximum des grands mouvements.



- Exemple :
- UT principale 1H
 - Déclencheur 15'



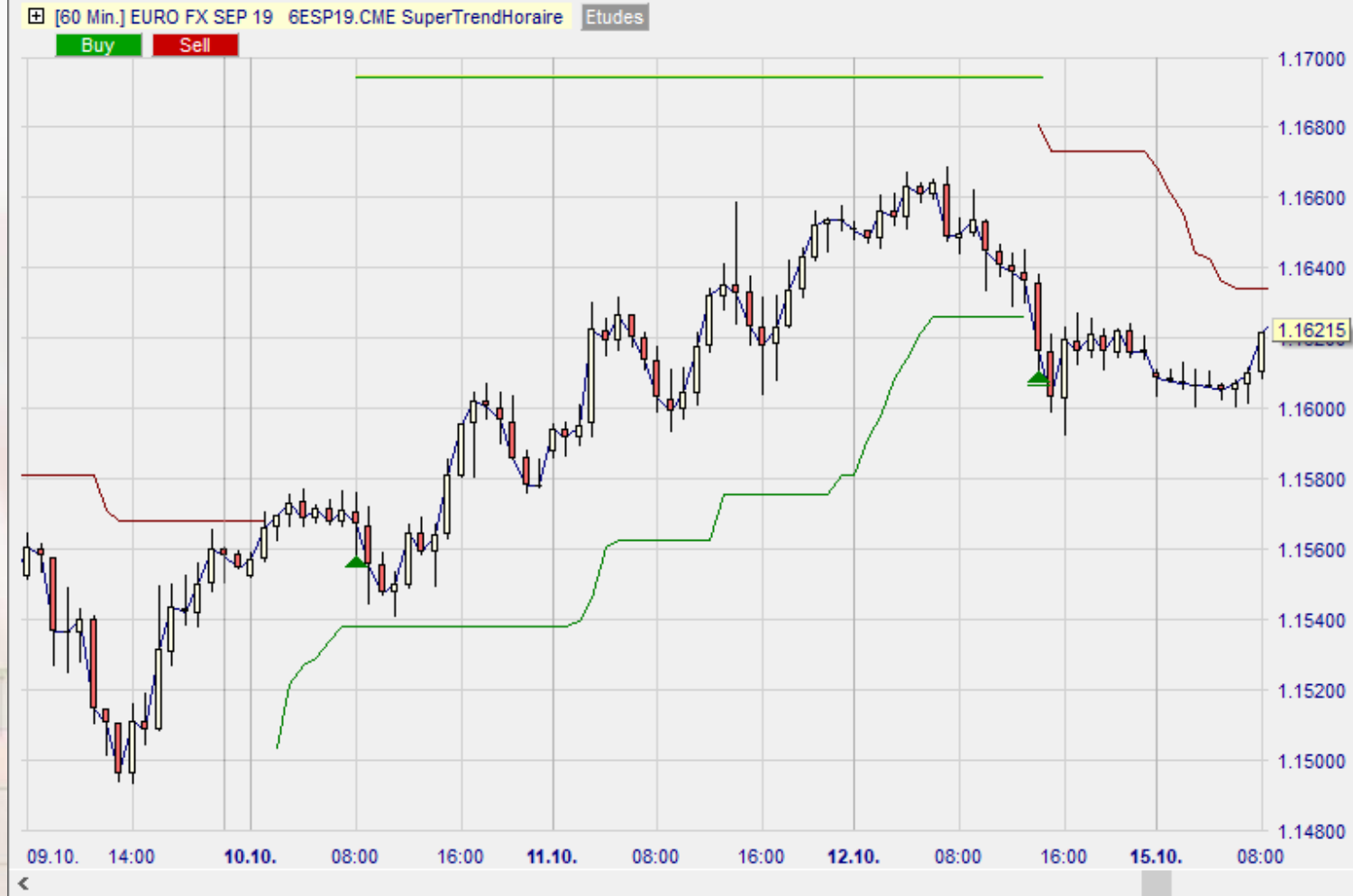
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Trend typique si la sortie est déterminée par l'inversion du Supertrend sur l'UT supérieure.

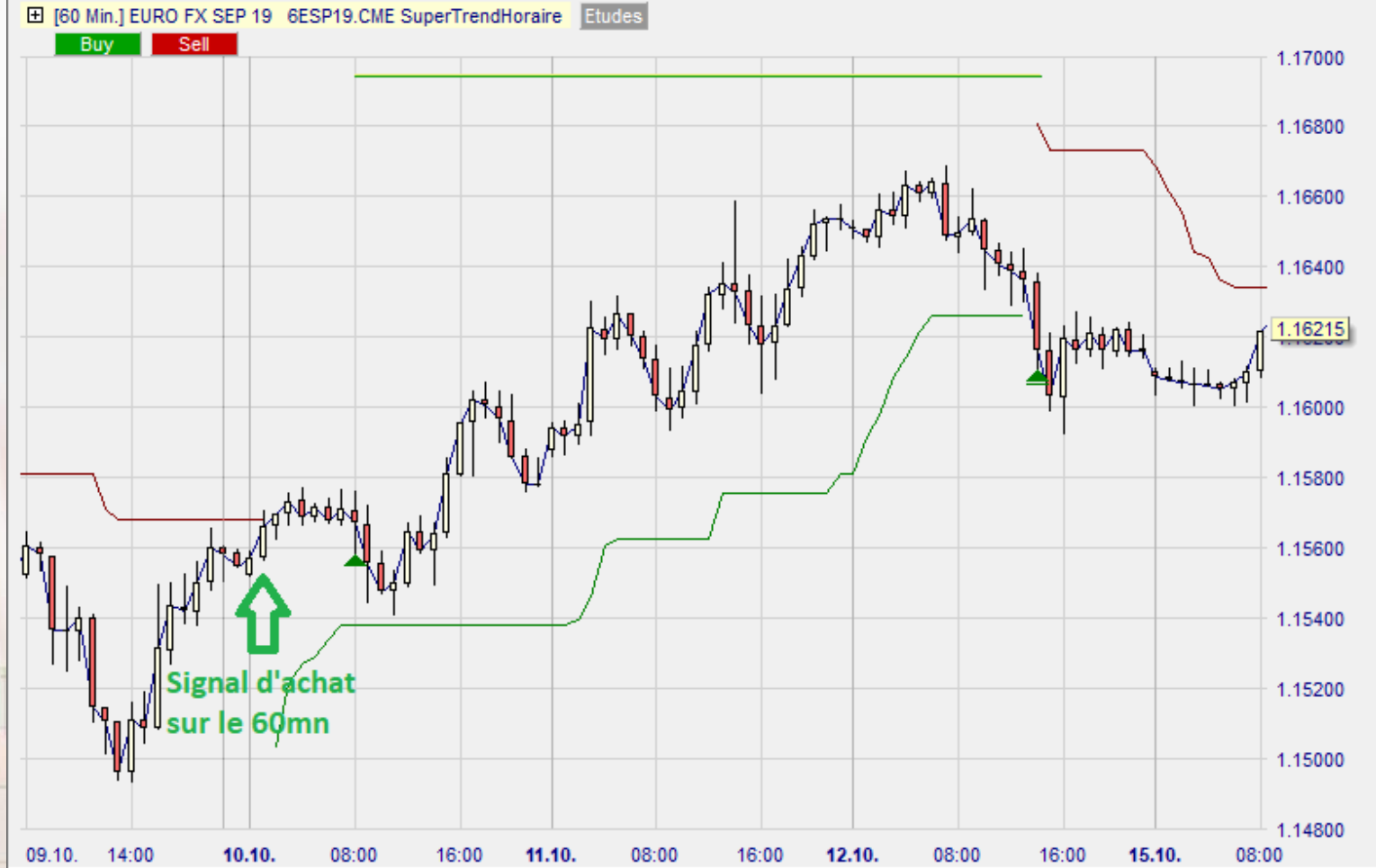
Nous allons le détailler.

Rapide présentation du Metasentimentor ?



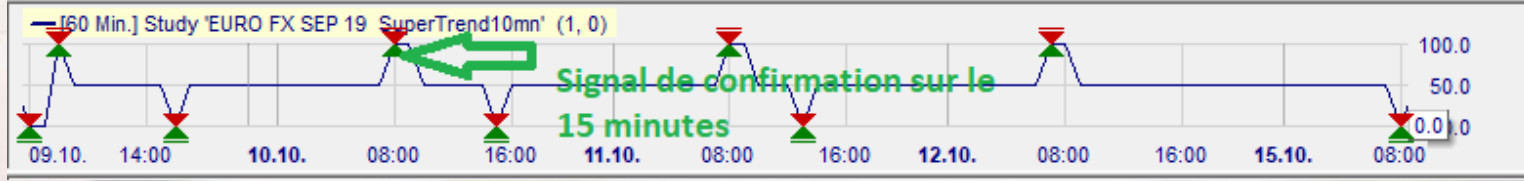
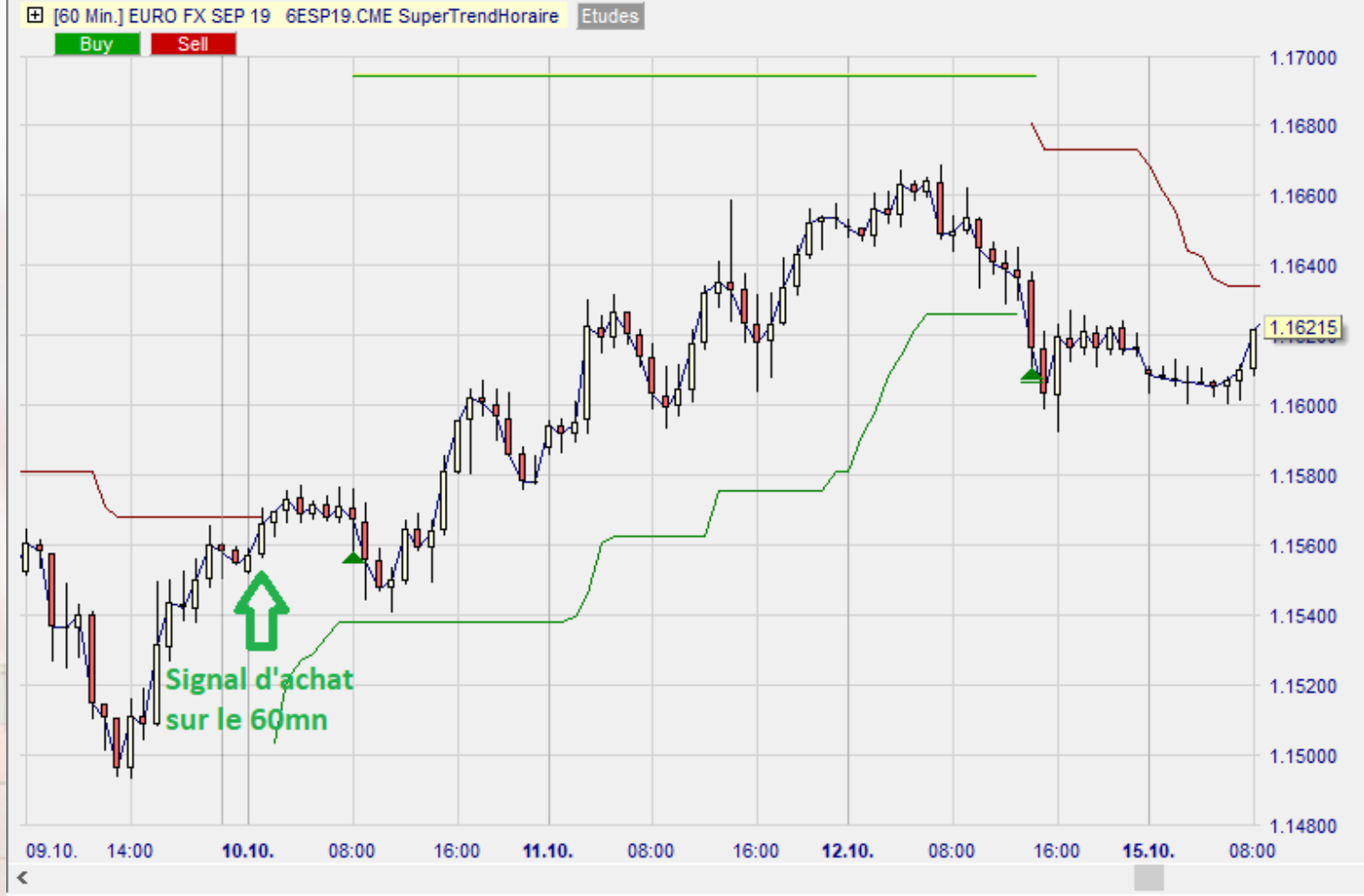
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



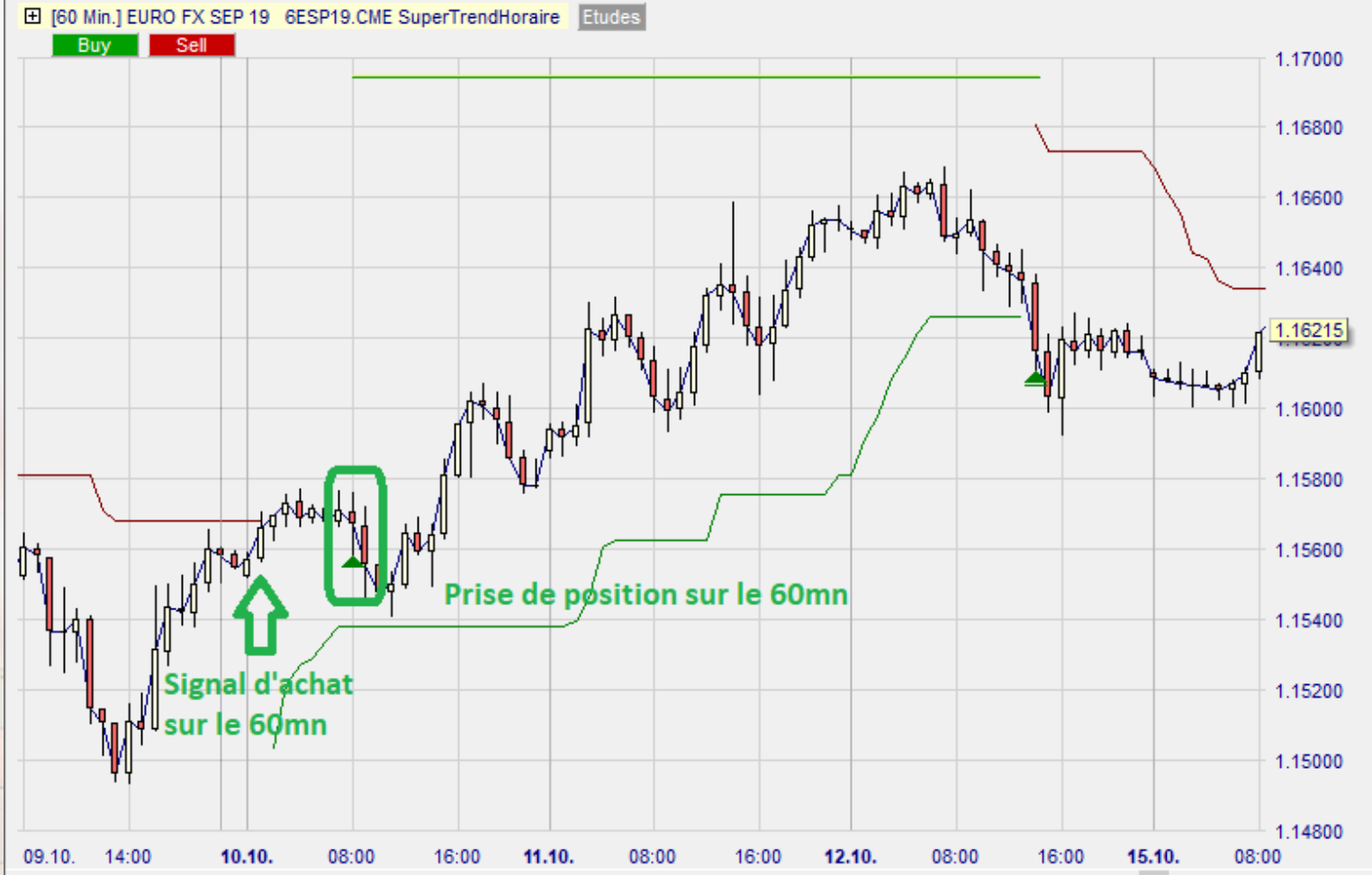
Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V



Mogalef Trading

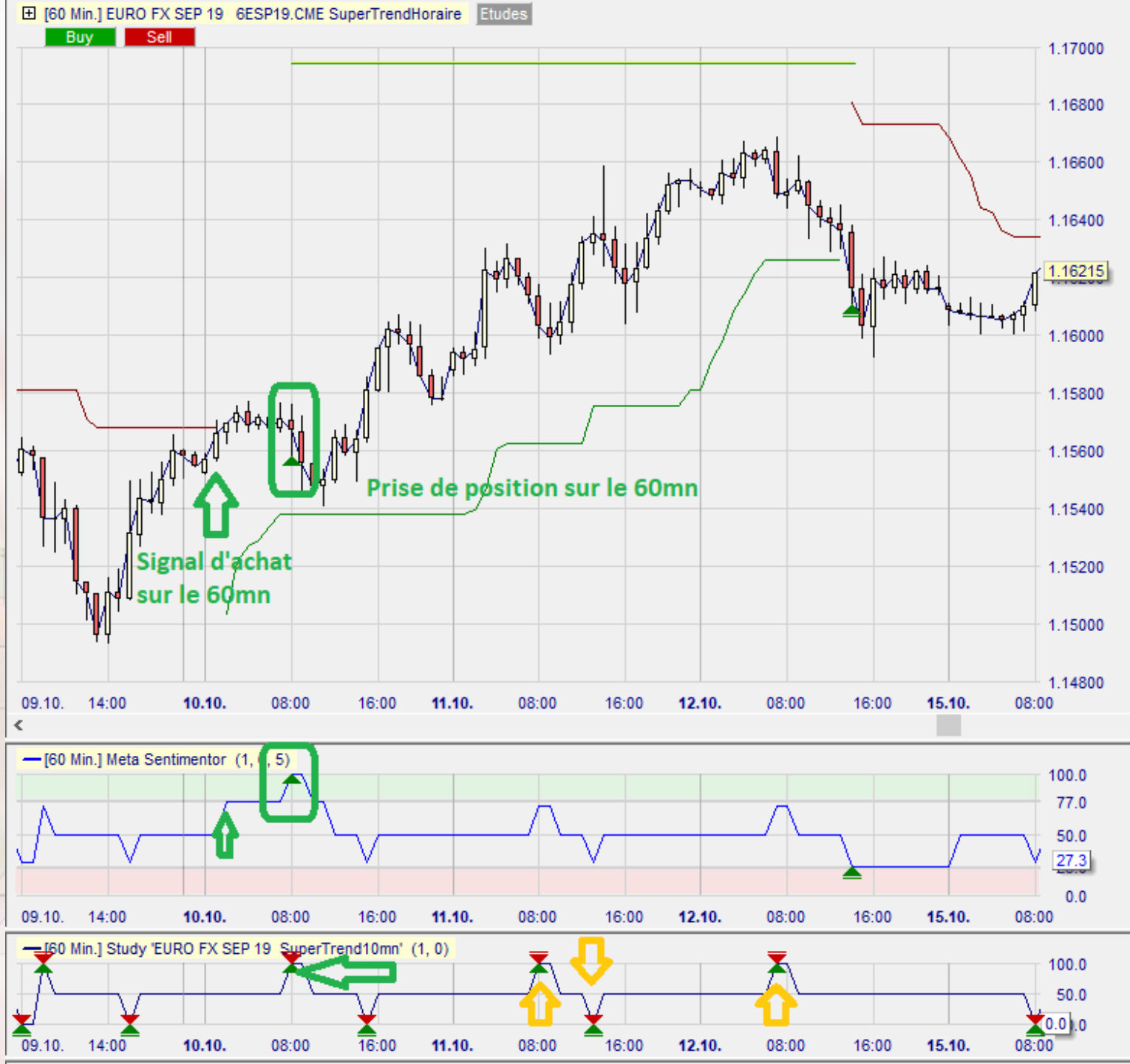
"There's no certitude, only opportunities" V



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

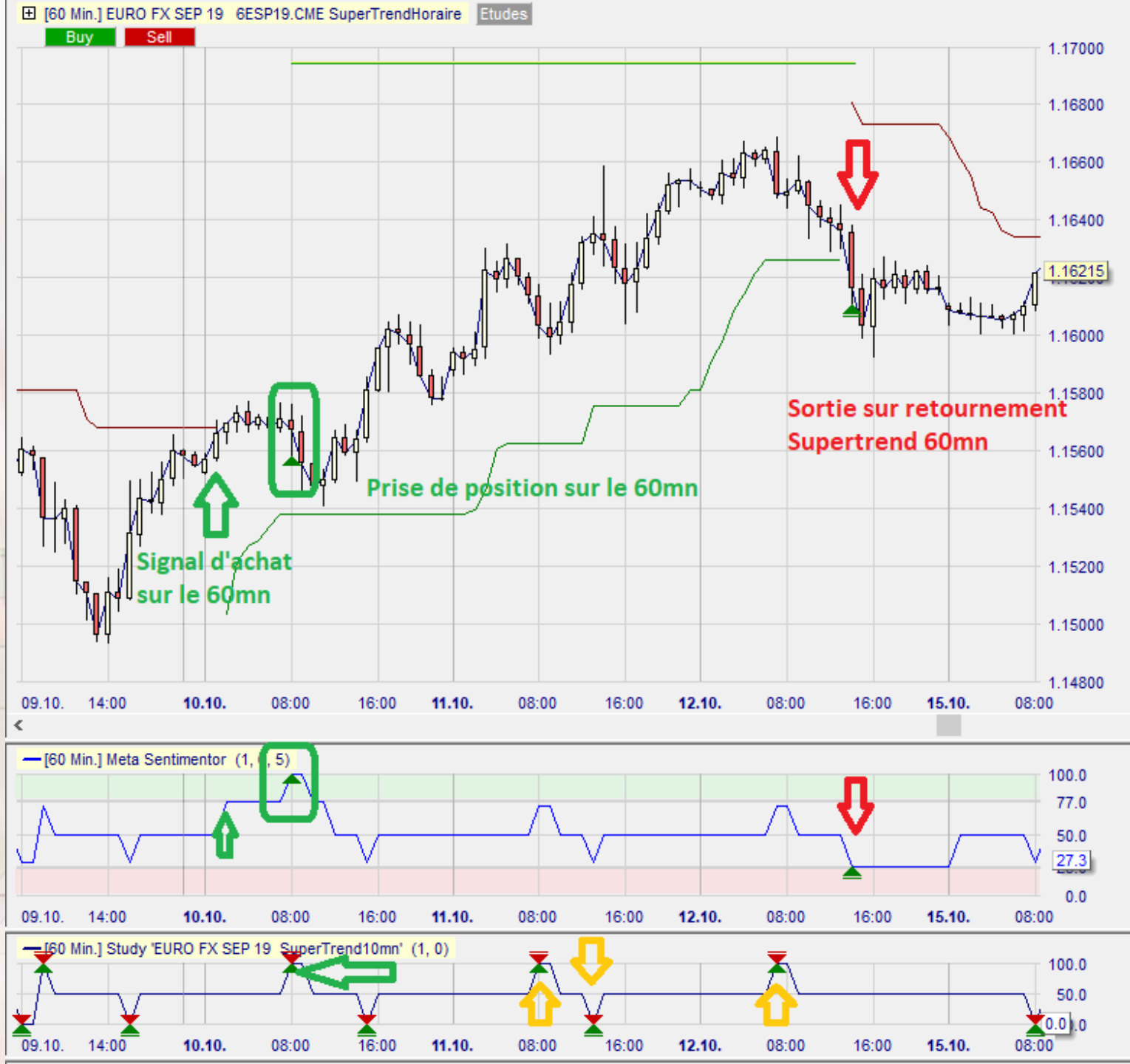
- Les signaux d'achat et de vente sur la petite UT de confirmation n'influent pas sur la position.



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

- Ce n'est que lorsque le SuperTrend du 60mn se retourne que l'ordre de sortie de position est lancé.



Comment paramétrer l'UT supérieure (le 60mn)

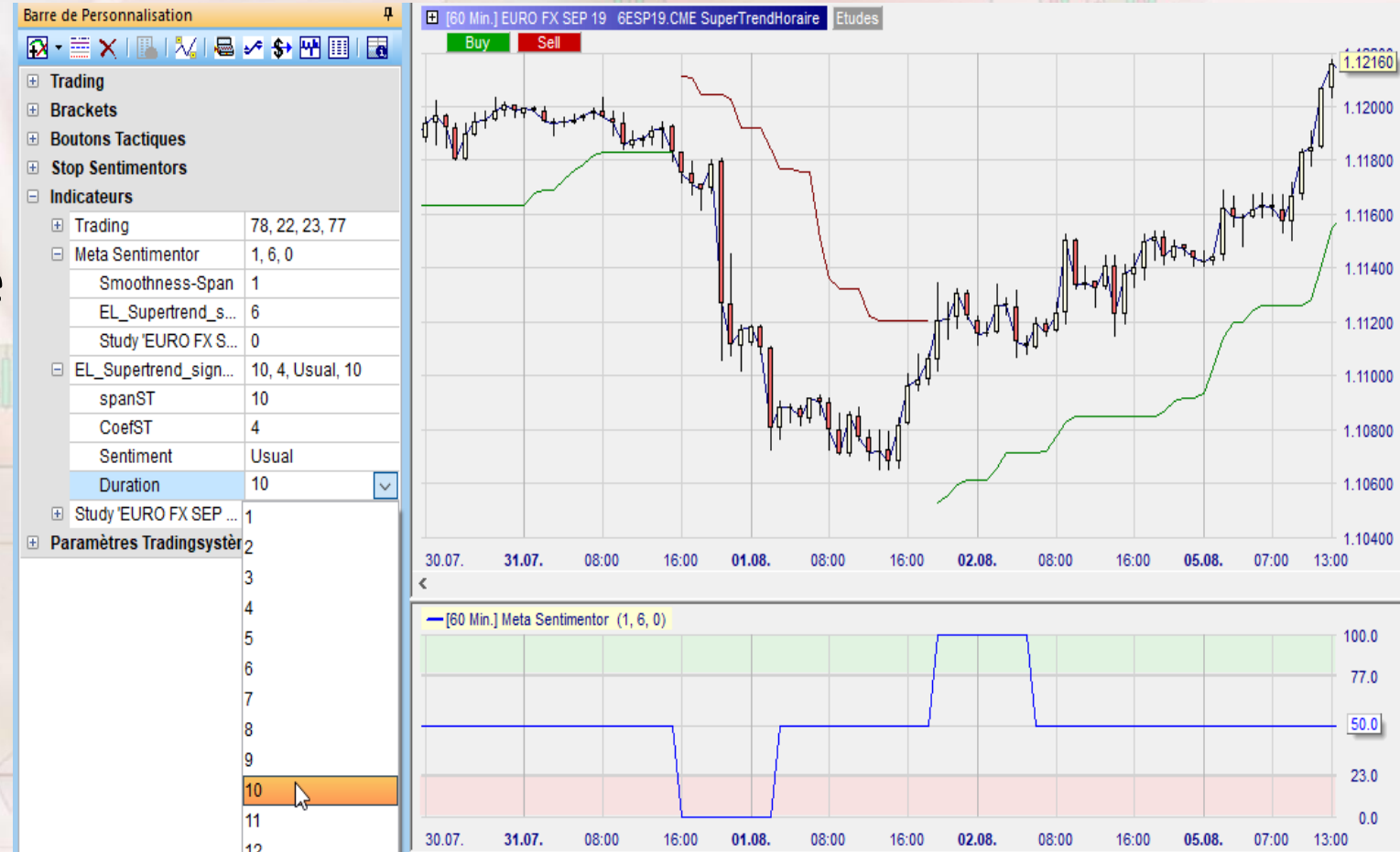
- On rajoute :
- Le Metasentimentor
- Le Supertrend



- On voit que le Metasentimentor donne un signal d'achat ou de vente quand le ST se retourne.
- MAIS ce signal ne dure qu'une heure. Or il nous faudra peut-être attendre plusieurs heures avant que l'UT inférieure (15mn) ne nous donne la confirmation.
- Il est donc nécessaire que le signal du 60mn se prolonge pour attendre la confirmation du 15mn le temps nécessaire.

Indicateur SuperTrend amélioré

- Il vous est fourni un ST amélioré qui permet de « faire durer » les signaux d'achat et de vente sur l'UT supérieure (le 60mn) de manière à attendre la confirmation de l'UT inférieure (15mn).
- C'est EL_Supertrend_signal
- Le paramètre pour faire durer le signal est : DURATION. Ici il est par exemple réglé à 10.



Le signal 60mn restera donc valide et attendra la confirmation du 15mn pendant 10 heures

Comment paramétrer l'UT inférieure

Sur l'UT inférieure (ici le 15mn)

- On intègre le SuperTrend
 - On intègre le MetaSentimentor
 - On voit que dans le MetaSentimentor que :
 - SuperTrend passe vert = achat
 - SuperTrend passe rouge = Vente
- Ce n'est pas ce que nous voulons.



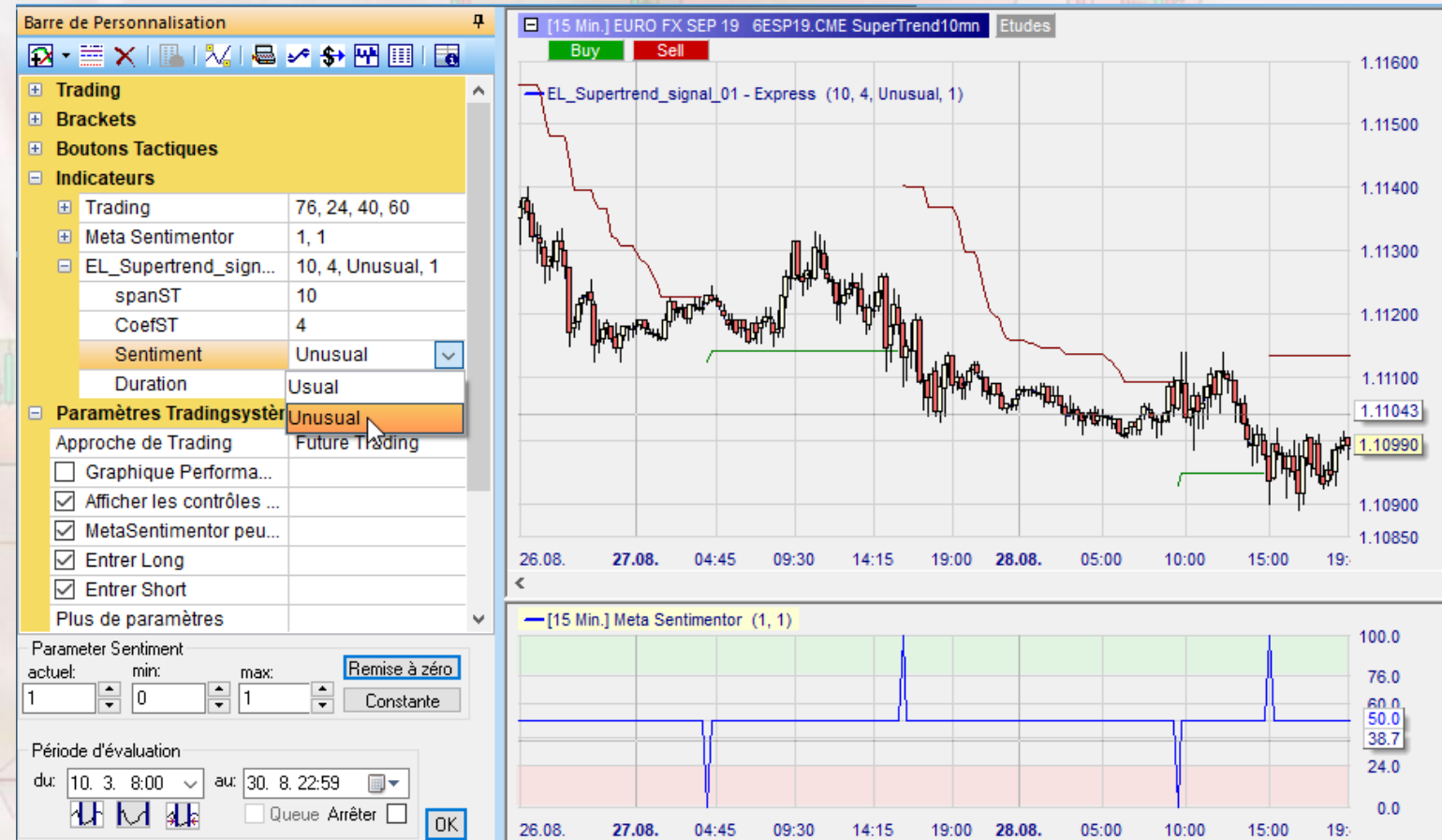
UT inférieure (15mn)

Nous voulons que l'UT 15mn

- Dise **Achat** si le ST passe **rouge**.
- Dise **Vente** si le ST passe **vert**.

Il est donc nécessaire de ne pas utiliser le ST d'origine mais plutôt un ST **réversible**.

- J'ai écrit ce nouvel indicateur, il vous est fourni :
EL_Supertrend_signal



On règle le sentiment sur UNUSUAL (inhabituel)

UT inférieure (15mn)

- Mais le signal d'achat ou de vente ne sera donné qu'à un quart d'heure (15mn) précis qui peut être par exemple 10h ou 10h15 ou 10h30...
- Or notre UT principale est le 60mn. Si un signal est donné à 10h15 il ne sera plus valide à 10h30, et encore moins à 11h qui est l'heure à laquelle notre UT principale attend le signal de notre UT secondaire.
- Il est donc nécessaire « d'allonger » le signal de l'UT secondaire (15mn) pour que l'UT principale (60mn) puissent détecter ce signal,
- C'est le rôle du paramètre DURATION.

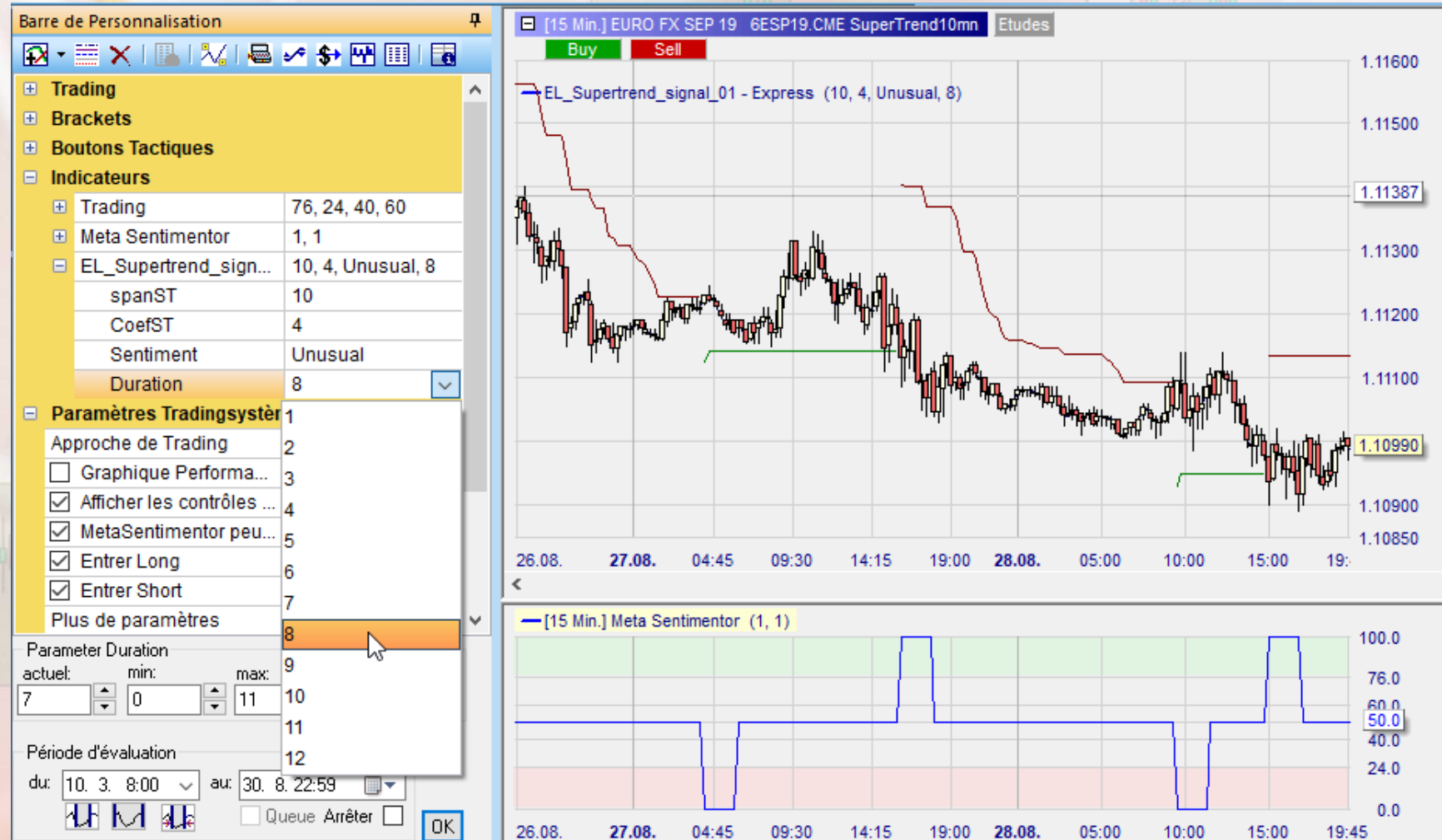
Note : si le signal secondaire a lieu à 10h15 (bougie de 10h à 10h15, c'est-à-dire bougie de 10h) il faut une durée de 4 pour répercuter ce signal sur l'UT principale. Ainsi le signal sera effectif sur les bougies de 10h, 10h15, 10h30, 10h45, donc jusqu'à 11h, heure de clôture de la bougie de 10h sur l'UT horaire.

UT inférieure (15mn)

- Ici par exemple on règle la Duration à 8.
- Le signal d'achat est répété 8 quarts d'heure de suite.

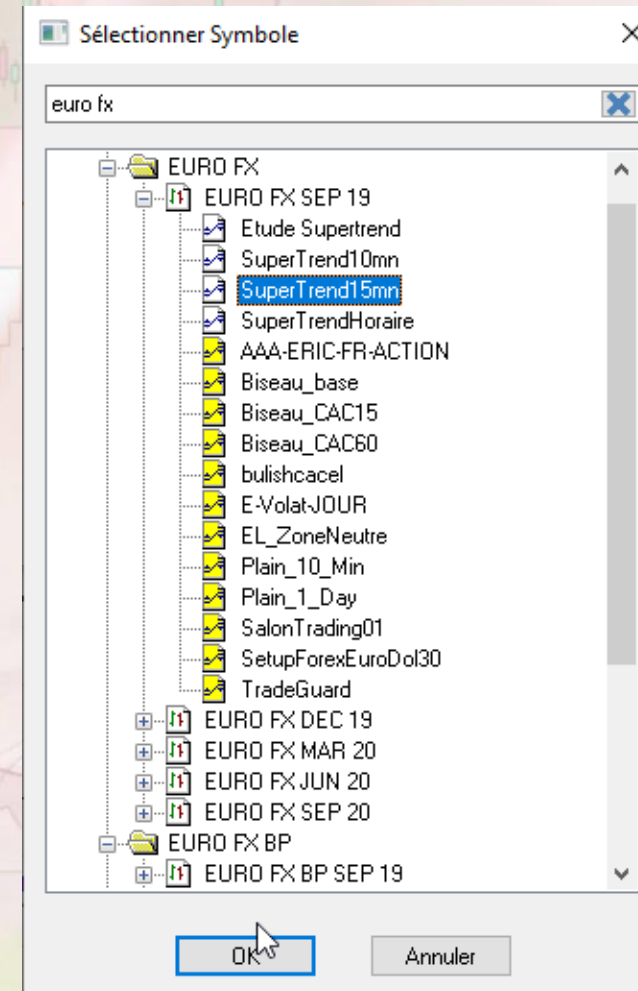
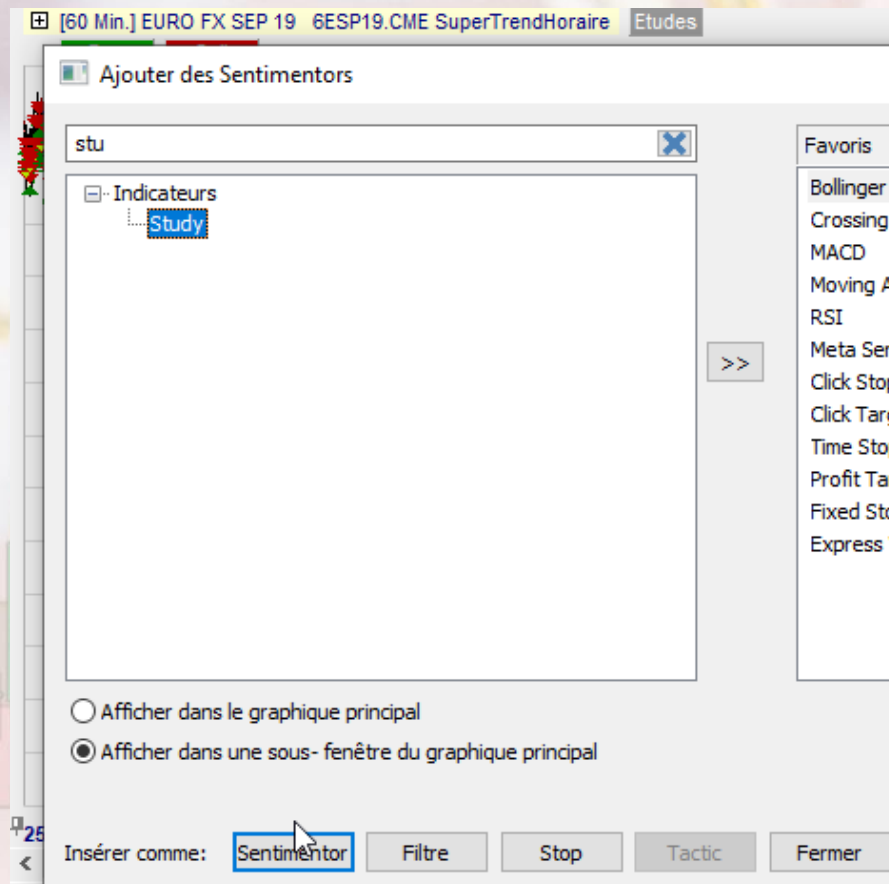
Note :

Une durée de 8 permet aussi de retarder certains signaux de sortie pour éviter de sortir sur une poussée défavorable des cours.



Coordonner les 2 UT

- Il ne reste plus qu'à inclure l'étude 15mn dans l'étude 60mn.



Réglage du MetaSentimentor et des paramètres de trading



Sur l'UT principale (60mn) :

- On règle les « poids » dans le MetaSentimentor (poids 6 et 5).
- On règle les niveaux dans les paramètres de Trading.
- Le système aura ainsi le comportement souhaité.

PAS D'AFFOLEMENT :

Un modèle prêt à l'emploi vous est fourni. Vous n'aurez qu'à l'appliquer pour reproduire l'ensemble des réglages de ce système.

Autres indicateurs inclus dans l'UT 60mn pour le système présenté

Pour compléter le système j'ai inclus dans le 60mn :

- Un objectif (profit target)
- Un Time stop

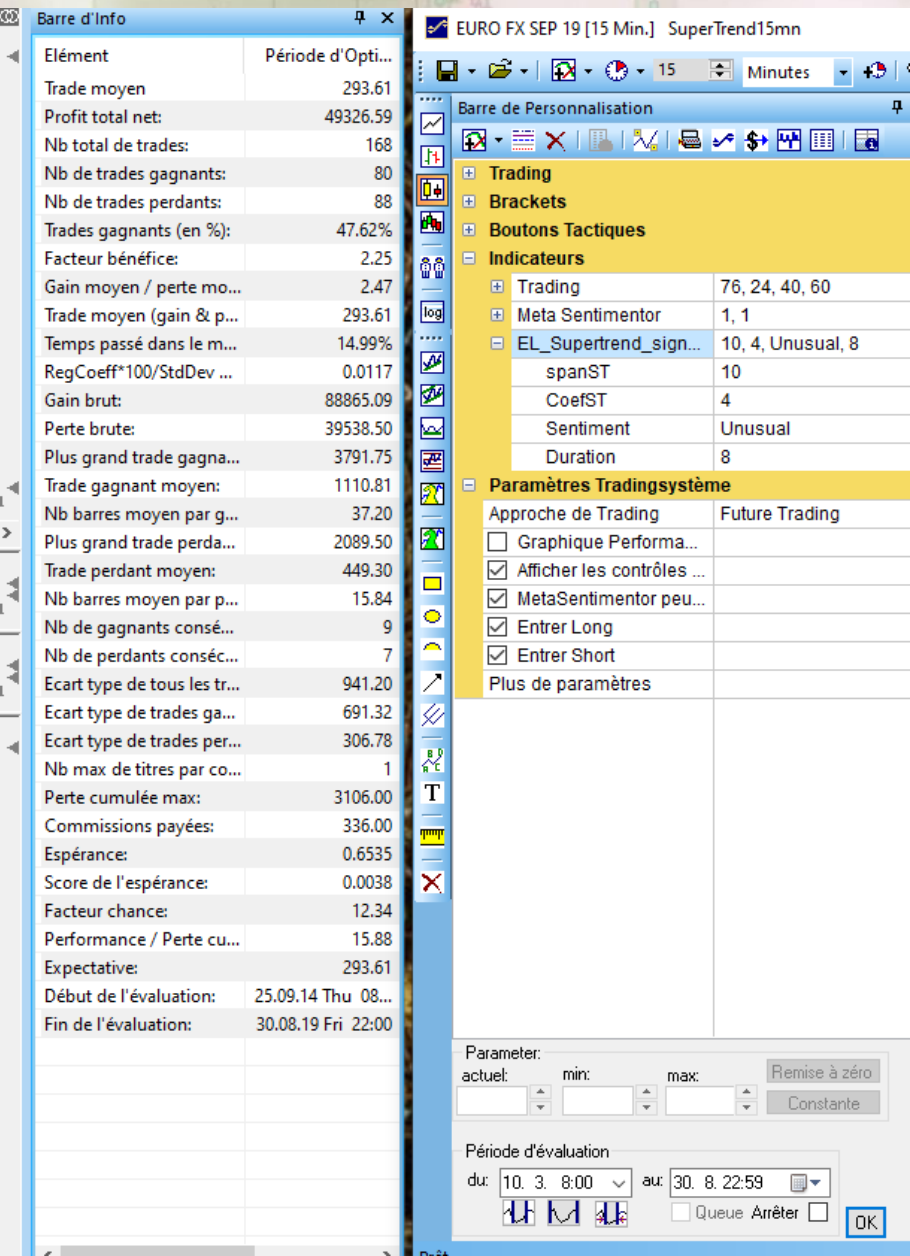
Barre de Personnalisation

Trading	
Brackets	
Profit Target	9, 6
Target Long: *ATR	9
Target Short: *ATR	6
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	
Boutons Tactiques	
Stop Sentimentors	
Time Stop	50
Max Periods	50
Indicateurs	
Trading	78, 22, 23, 77
Threshold Long	78
Threshold Short	22
Close Long	23
Close Short	77
Meta Sentimentor	1, 6, 5
Smoothness-Span	1
EL_Supertrend_s...	6
Study n/a weight	5
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Usual, 10
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Usual
Duration	10
Study 'EURO FX SEP ...	1, 0
Sentiment Mappin...	1
Optimize Embedd...	0

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities"

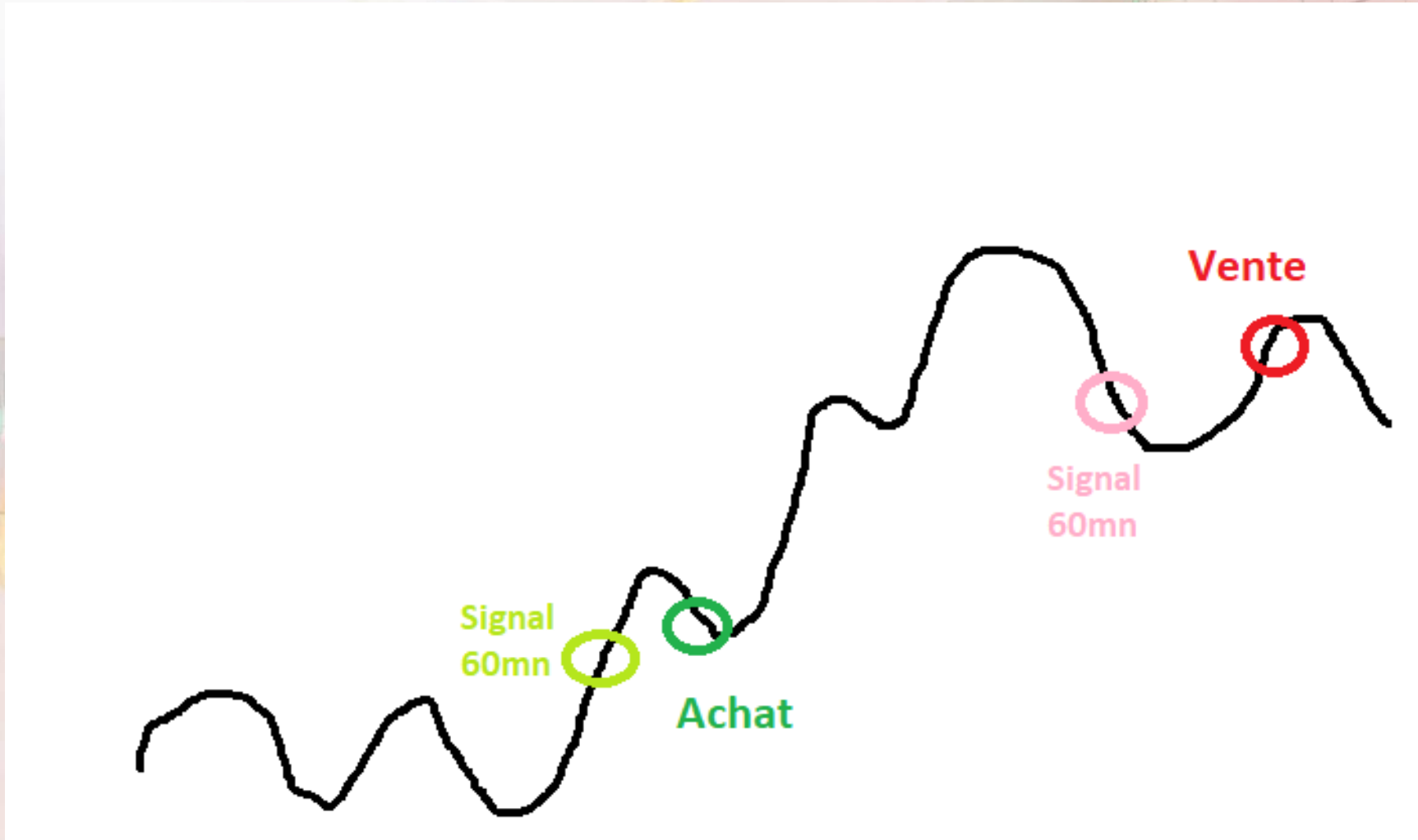
Aperçu des performances



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

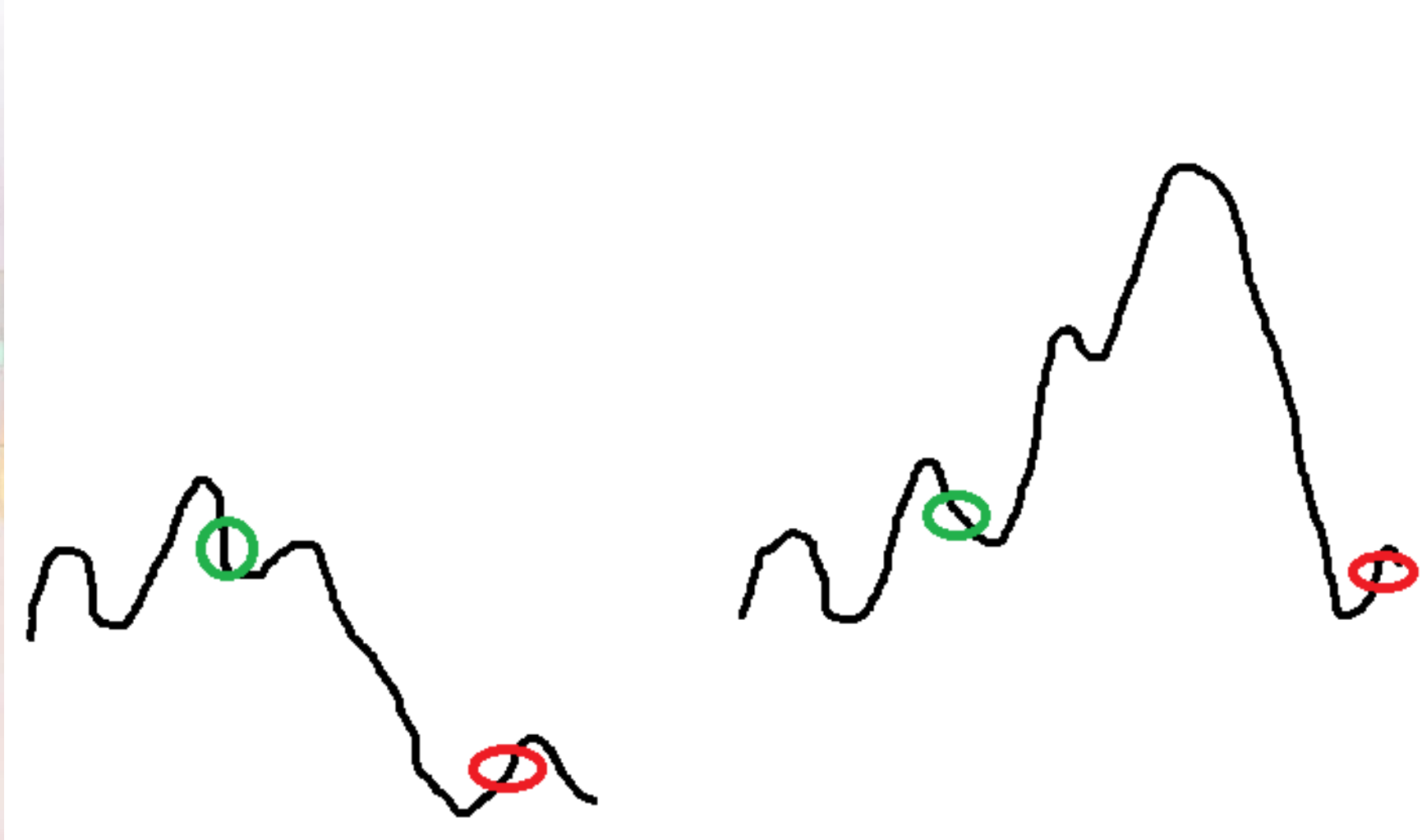
Variation : sortir sur signaux simultanés du 15mn et du 60mn



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Mais dans cette configuration le risque sera plus important car on peut rencontrer ces types de comportement des cours :



Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities"

Variation : sortir sur signaux simultanés du 15mn et du 60mn

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Profit Target	9, 6
Target Long: *ATR	9
Target Short: *ATR	6
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

Boutons Tactiques

Stop Sentimentors

Time Stop	50
Max Periods	50

Indicateurs

Trading	78, 22, 23, 77
Meta Sentimentor	1, 6, 5
Smoothness-Span	1
EL_Supertrend_s...	5
Study n/a weight	5
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Usual, 10
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Usual
Duration	10
Study 'EURO FX SEP ...	1, 0
Sentiment Mappin...	1
Optimize Embedd...	0

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading: Future Trading

Graphique Performa...

Afficher les contrôles ...

MetaSentimentor peu...

Entrer Long

Entrer Short

Parameter EL_Supertrend_signal_01 - Express weight:

actuel:	min:	max:	Remise à zéro
5	0	10	Constante

Période d'évaluation

du: 25. 9. 8:00 au: 30. 8. 22:59



Barre d'Info

Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	376.36
Profit total net:	60969.83
Nb total de trades:	162
Nb de trades gagnants:	101
Nb de trades perdants:	61
Trades gagnants (en %):	62.35%
Facteur bénéficié:	2.59
Gain moyen / perte mo...	1.57
Trade moyen (gain & p...	376.36
Temps passé dans le m...	21.31%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0116
Gain brut:	99241.83
Perte brute:	38272.00
Plus grand trade gagna...	3791.75
Trade gagnant moyen:	982.59
Nb barres moyen par g...	37.19
Plus grand trade perda...	3014.50
Trade perdant moyen:	627.41
Nb barres moyen par p...	40.25
Nb de gagnants consé...	10
Nb de perdants consé...	7
Ecart type de tous les tr...	1035.39
Ecart type de trades ga...	708.54
Ecart type de trades per...	630.01
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4604.00
Commissions payées:	324.00
Espérance:	0.5999
Score de l'espérance:	0.0033
Facteur chance:	13.86
Performance / Perte cu...	13.24
Expectative:	376.36
Début de l'évaluation:	25.09.14 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	30.08.19 Fri 22:00

EURO FX SEP 19 [15 Min.] SuperTrend15mn

Barre de Personnalisation

Trading

Brackets

Boutons Tactiques

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Unusual, 8
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Unusual
Duration	8

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading: Future Trading

Graphique Performa...

Afficher les contrôles ...

MetaSentimentor peu...

Entrer Long

Entrer Short

Plus de paramètres

Parameter:

actuel:	min:	max:	Remise à zéro
			Constante

Période d'évaluation

du: 10. 3. 8:00 au: 30. 8. 22:59

Queue Arrêter

Barre de Personnalisation

Trading

- Brackets

Profit Target	9, 6
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
- Boutons Tactiques
- Stop Sentimentors

Time Stop	50
Max Periods	50
- Indicateurs

Trading	78, 22, 23, 77
Meta Sentimentor	1, 5, 5
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Usual, 10
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Usual
Duration	10
- Study 'EURO FX SEP ...'

1, 0

- Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter:
actuel: min: max: Remise à zéro
Constante

Période d'évaluation
du: 25. 9. 8:00 au: 30. 8. 22:59
Queue Arrêter OK

EURO FX SEP 19 [15 Min.] Etude Supertrend

EURO FX SEP 19 [60 Min.] SuperTrendHoraire

Barre d'Info

Élément Période d'Opti...

Trade moyen	430.59
Profit total net:	52962.58
Nb total de trades:	123
Nb de trades gagnants:	82
Nb de trades perdants:	41
Trades gagnants (en %):	66.67%
Facteur bénéfice:	2.96
Gain moyen / perte mo...	1.48
Trade moyen (gain & p...	430.59
Temps passé dans le m...	16.63%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0116
Gain brut:	80037.58
Perte brute:	27075.00
Plus grand trade gagna...	3000.00
Trade gagnant moyen:	976.07
Nb barres moyen par g...	37.76
Plus grand trade perda...	3012.50
Trade perdant moyen:	660.37
Nb barres moyen par p...	42.61
Nb de gagnants consé...	9
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	1025.75
Ecart type de trades ga...	673.48
Ecart type de trades per...	678.75
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4700.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6520
Score de l'espérance:	0.0028
Facteur chance:	14.62
Performance / Perte cu...	11.27
Expectative:	430.59
Début de l'évaluation:	25.09.14 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	30.08.19 Fri 22:00

Barre de Personnalisation

Trading

Compte	Choix...
Volume d'Ordre	1
Etat automatization	Désactivé
Type d'Ordre Limite	n/a - Choisissez d'...
Type d'Ordre Stop	n/a - Choisissez d'...

Brackets

Boutons Tactiques

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
Smoothness-Span	1
EL_Supertrend_s...	1
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Unusual, 3
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Unusual
Duration	3

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter Duration
actuel: min: max: Remise à zéro
2 0 11 Constante

Période d'évaluation
du: 10. 3. 8:00 au: 30. 8. 22:59
Queue Arrêter OK

Barre d'Info

Élément Période d'Opti...

Trade moyen	430.59
Profit total net:	52962.58
Nb total de trades:	123
Nb de trades gagnants:	82
Nb de trades perdants:	41
Trades gagnants (en %):	66.67%
Facteur bénéfice:	2.96
Gain moyen / perte mo...	1.48
Trade moyen (gain & p...	430.59
Temps passé dans le m...	16.63%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0116
Gain brut:	80037.58
Perte brute:	27075.00
Plus grand trade gagna...	3000.00
Trade gagnant moyen:	976.07
Nb barres moyen par g...	37.76
Plus grand trade perda...	3012.50
Trade perdant moyen:	660.37
Nb barres moyen par p...	42.61
Nb de gagnants consé...	9
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	1025.75
Ecart type de trades ga...	673.48
Ecart type de trades per...	678.75
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4700.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6520
Score de l'espérance:	0.0028
Facteur chance:	14.62
Performance / Perte cu...	11.27
Expectative:	430.59
Début de l'évaluation:	25.09.14 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	30.08.19 Fri 22:00

EURO FX SEP 19 [15 Min.] SuperTrendHoraire

Barre de Personnalisation

Trading

- Brackets

Profit Target	9, 6
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
- Boutons Tactiques
- Stop Sentimentors

Time Stop	50
Max Periods	50
- Indicateurs

Trading	78, 22, 23, 77
Meta Sentimentor	1, 5, 5
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Usual, 10
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Usual
Duration	10
- Study 'EURO FX SEP ...'

1, 0

- Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter:
actuel: min: max: Remise à zéro
Constante

Période d'évaluation
du: 25. 9. 8:00 au: 30. 8. 22:59
Queue Arrêter OK

EURO FX SEP 19 [60 Min.] SuperTrendHoraire

Barre d'Info

Élément Période d'Opti...

Trade moyen	430.59
Profit total net:	52962.58
Nb total de trades:	123
Nb de trades gagnants:	82
Nb de trades perdants:	41
Trades gagnants (en %):	66.67%
Facteur bénéfice:	2.96
Gain moyen / perte mo...	1.48
Trade moyen (gain & p...	430.59
Temps passé dans le m...	16.63%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0116
Gain brut:	80037.58
Perte brute:	27075.00
Plus grand trade gagna...	3000.00
Trade gagnant moyen:	976.07
Nb barres moyen par g...	37.76
Plus grand trade perda...	3012.50
Trade perdant moyen:	660.37
Nb barres moyen par p...	42.61
Nb de gagnants consé...	9
Nb de perdants consé...	6
Ecart type de tous les tr...	1025.75
Ecart type de trades ga...	673.48
Ecart type de trades per...	678.75
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	4700.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.6520
Score de l'espérance:	0.0028
Facteur chance:	14.62
Performance / Perte cu...	11.27
Expectative:	430.59
Début de l'évaluation:	25.09.14 Thu 08...
Fin de l'évaluation:	30.08.19 Fri 22:00

Barre de Personnalisation

Trading

Compte	Choix...
Volume d'Ordre	1
Etat automatization	Désactivé
Type d'Ordre Limite	n/a - Choisissez d'...
Type d'Ordre Stop	n/a - Choisissez d'...

Brackets

Boutons Tactiques

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
Smoothness-Span	1
EL_Supertrend_s...	1
EL_Supertrend_sign...	10, 4, Unusual, 3
spanST	10
CoefST	4
Sentiment	Unusual
Duration	3

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter Duration
actuel: min: max: Remise à zéro
2 0 11 Constante

Période d'évaluation
du: 10. 3. 8:00 au: 30. 8. 22:59
Queue Arrêter OK

Un système plus simple

Nous avons vu que le signal SuperTrend n'est profitable (dans une faible mesure) qu'un tiers du temps environ. En adoptant un usage inverse du SuperTrend on peut obtenir des systèmes utilisables assez variés. Ici j'ai adopté les réglages suivants :

- Signal SuperTrend « unusual » avec un coef de 1
- Profit target à 5 ATR pour les longs et 6 ATR pour les courts
- Time Stop à 50 périodes

Les gains par trade générés sont assez faibles et il y a des périodes de perte, mais le principe semble solide dans le temps.

Mc

Barre d'Info



Trading

Brackets

Profit Target	5.00, 6.00
Target Long: *ATR	5.00
Target Short: *ATR	6.00
Unité pour Brackets etc.	ATR
Envergure de l'ATR	20
Limites Multiples	Non
Stops Multiples	Non
Information	
Raccourci Clavier	

Boutons Tactiques

Stop Sentimentors

Time Stop	50
Max Periods	50

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 1
EL_Supertrend_sign...	10, 1, Unusual, 1
spanST	10
CoefST	1
Sentiment	Unusual
Duration	1

Paramètres Tradingsystème

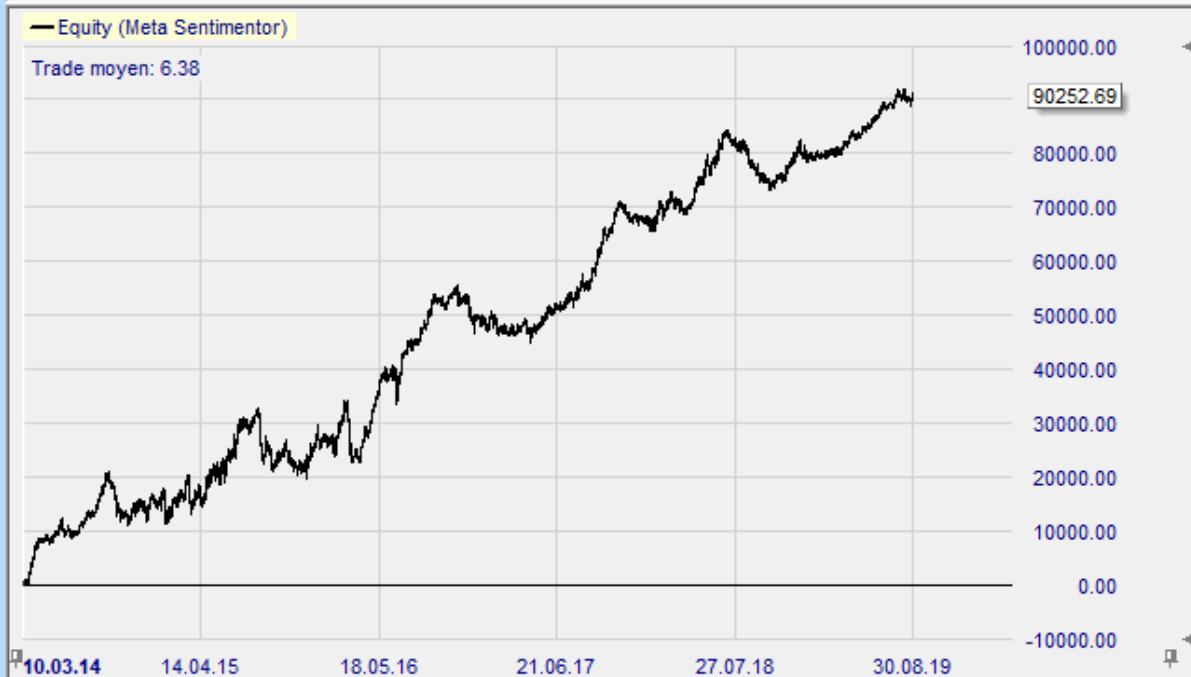
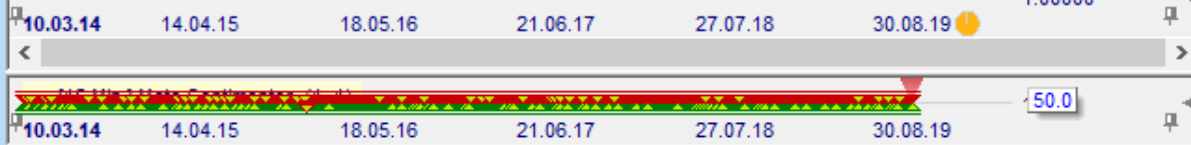
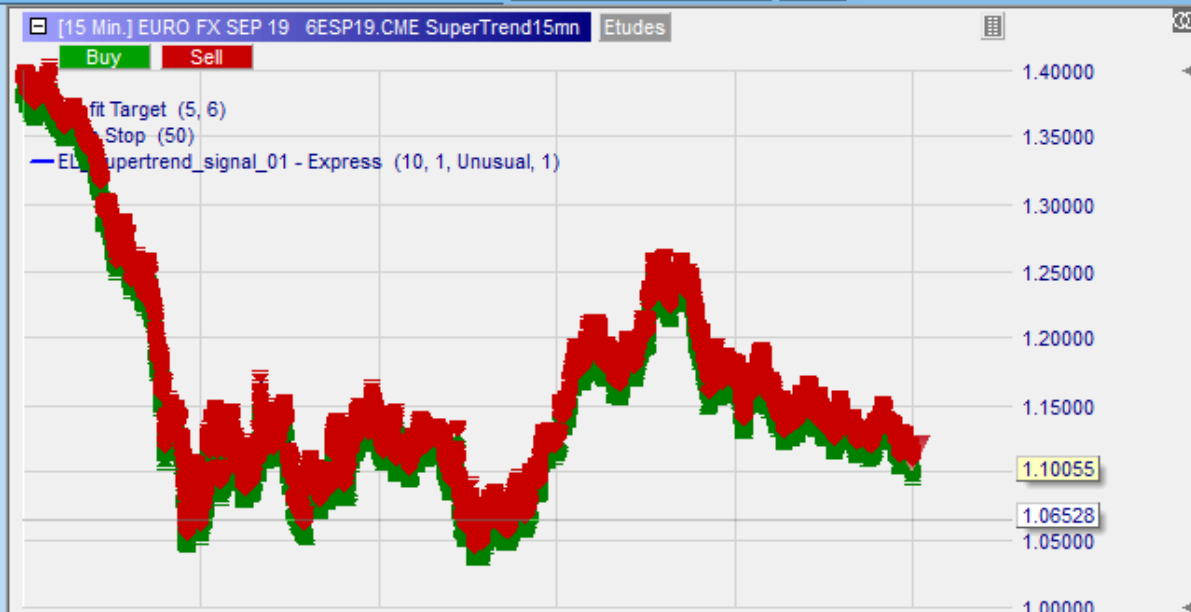
Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter CoefST

actuel: min: max:

Période d'évaluation

du: au:



Barre d'Info

Élément	Période d'Opti...
Trade moyen	6.38
Profit total net:	90076.19
Nb total de trades:	14125
Nb de trades gagnants:	9083
Nb de trades perdants:	5042
Trades gagnants (en %):	64.30%
Facteur bénéfice:	1.09
Gain moyen / perte mo...	0.61
Trade moyen (gain & p...	6.38
Temps passé dans le m...	99.82%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0026
Gain brut:	1058308.50
Perte brute:	968232.31
Plus grand trade gagna...	1260.92
Trade gagnant moyen:	116.52
Nb barres moyen par g...	5.81
Plus grand trade perda...	4095.35
Trade perdant moyen:	192.03
Nb barres moyen par p...	15.14
Nb de gagnants consé...	20
Nb de perdants consé...	8
Ecart type de tous les tr...	236.96
Ecart type de trades ga...	106.17
Ecart type de trades per...	275.28
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	12859.01
Commissions payées:	22596.84
Espérance:	0.0332
Score de l'espérance:	0.0036
Facteur chance:	5.42
Performance / Perte cu...	7.00
Expectative:	6.38
Début de l'évaluation:	10.03.14 Mon 0...
Fin de l'évaluation:	30.08.19 Fri 22:45

Données | Sentis | Eval

Mogalef Trading

"There's no certitude, only opportunities" V

Autre exemple

Sur UT 10mn

Barre de Personnalisation

Trading

Compte	Choix...
Volume d'Ordre	1
Etat automatisation	Désactivé
Type d'Ordre Limite	n/a - Choisissez d'...
Type d'Ordre Stop	n/a - Choisissez d'...

Brackets

Boutons Tactiques

Indicateurs

Trading	76, 24, 40, 60
Meta Sentimentor	1, 0, 1
EL_NeutralZone - Ex...	150, 90
EL_Supertrend_sign...	10, 1, Unusual, 10
spanST	10
CoefST	1
Sentiment	Unusual
Duration	10

Paramètres Tradingsystème

Approche de Trading	Future Trading
<input checked="" type="checkbox"/> Graphique Performa...	
<input checked="" type="checkbox"/> Afficher les contrôles ...	
<input checked="" type="checkbox"/> MetaSentimentor peu...	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Long	
<input checked="" type="checkbox"/> Entrer Short	
Plus de paramètres	

Parameter CoefST

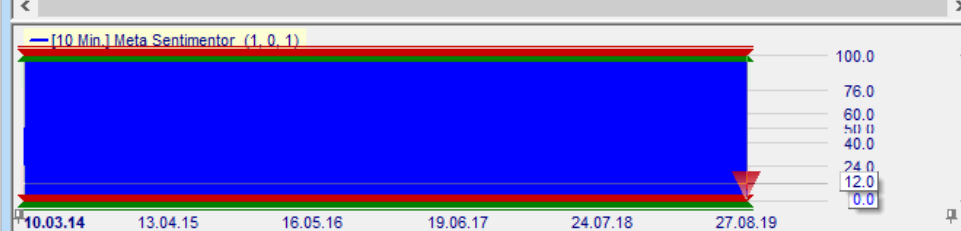
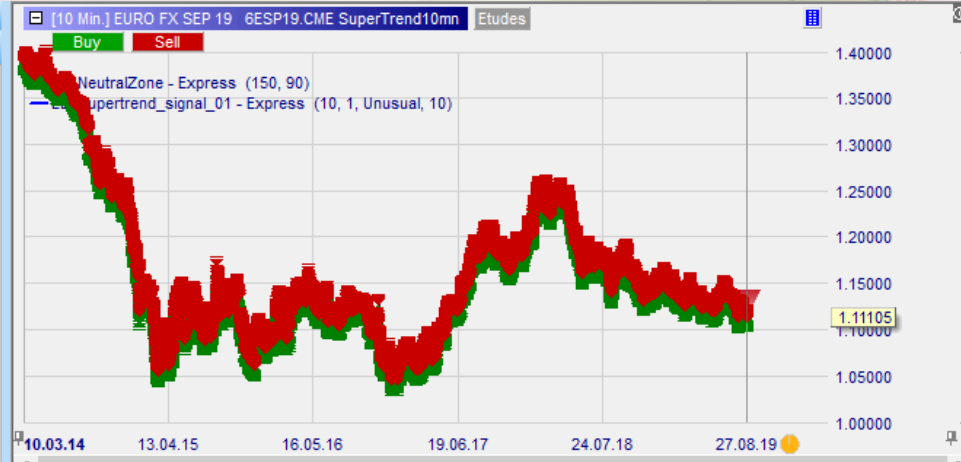
actuel: 1 min: 1 max: 10 Remise à zéro Constante

Période d'évaluation

du: 10. 3. 0:00 au: 27. 8. 19:00

Queue Arrêter

OK



Barre d'Info

Élément	Période d'Opti...
Profit total net:	115256.25
Nb total de trades:	21636
Nb de trades gagnants:	13827
Nb de trades perdants:	7809
Trades gagnants (en %):	63.91%
Facteur bénéfice:	1.10
Gain moyen / perte mo...	0.62
Trade moyen (gain & p...	5.33
Temps passé dans le m...	99.99%
RegCoeff*100/StdDev ...	0.0018
Gain brut:	1281462.50
Perte brute:	1166206.25
Plus grand trade gagna...	2462.50
Trade gagnant moyen:	92.68
Nb barres moyen par g...	5.68
Plus grand trade perda...	5012.50
Trade perdant moyen:	149.34
Nb barres moyen par p...	14.73
Nb de gagnants consé...	19
Nb de perdants consé...	8
Ecart type de tous les tr...	192.87
Ecart type de trades ga...	92.17
Ecart type de trades per...	224.93
Nb max de titres par co...	1
Perte cumulée max:	18600.00
Commissions payées:	0.00
Espérance:	0.0357
Score de l'espérance:	0.0040
Facteur chance:	4.86
Performance / Perte cu...	6.20
Expectative:	5.33
Début de l'évaluation:	10.03.14 Mon 0...
Fin de l'évaluation:	27.08.19 Tue 19...

Données | Sentis | Eval

Télécharger le PDF et les indicateurs

- Rendez-vous sur le site Mogalef-Trading
- Menu HOME
- Conférences WHS 2019
- Mot de passe : Albireo

*Merci de votre présence
et de votre participation*